

Threadneedle (Lux)

Informe provisional y estados financieros no auditados
Société d'Investissement à Capital Variable
30 de septiembre de 2023

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

Contenidos

Información sobre la Sociedad	4	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	50
Estados financieros:		Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	51
Estados financieros agregados de Threadneedle (Lux)	5	Threadneedle (Lux) - European Select	53
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	6	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	55
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	8	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	56
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	10	Threadneedle (Lux) - Global Technology	57
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	12	Threadneedle (Lux) - UK Equities	58
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	13	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	60
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	15	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha*	62
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	16	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	63
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	17	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	65
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	18	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	67
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	19	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	68
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	21	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	69
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return*	22	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	70
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	23	Estados de la Cartera	
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	24	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	71
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities*	26	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	81
Threadneedle (Lux) - Global Focus	27	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	87
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	29	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	95
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	30	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	100
Threadneedle (Lux) - Global Select	32	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	107
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	33	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	114
Threadneedle (Lux) - American	35	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	119
Threadneedle (Lux) - American Select	37	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	124
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	39	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	129
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	41	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	139
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	42	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	143
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	43	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	146
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	44	Threadneedle (Lux) - Global Focus	161
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	46	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	163
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	48		

Contenidos

(continuación)

Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	166
Threadneedle (Lux) - Global Select	168
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	170
Threadneedle (Lux) - American	172
Threadneedle (Lux) - American Select	174
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	175
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	177
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	179
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	181
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	183
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	184
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	186
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	188
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	190
Threadneedle (Lux) - European Select	192
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	194
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	196
Threadneedle (Lux) - Global Technology	198
Threadneedle (Lux) - UK Equities	199
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	200
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	201
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	206
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	209
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	210
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	211
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	213
Notas a los estados financieros	214
Información para los accionistas	313
Información para inversores en Suiza	314
Reglamento de operaciones de financiación de valores	315
Directorio	317

* Consulte la nota 1.

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

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

Información sobre la Sociedad

Sociedad

Threadneedle (Lux)
R.C.S. Luxemburgo n.º B-50.216

Domicilio social

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

Sociedad Gestora

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

Consejo de Administración

Claude Kremer
Consejero independiente no ejecutivo
Luxemburgo
Gran Ducado de Luxemburgo

Julie Griffiths (renunció al Consejo de Administración
el 28 de septiembre de 2023)

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

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

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

Thomas Seale
Consejero independiente no ejecutivo
Luxemburgo
Gran Ducado de Luxemburgo

Estados financieros agregados de Threadneedle (Lux)

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2, 18	15.988.462.787
Efectivo en el banco	2	188.058.010
Depósitos a plazo	2, 19	11.249.433
Por cobrar para la venta de inversiones		64.382.681
Suscripciones por cobrar		15.124.098
Interés por cobrar en swaps	2	2.997.638
Interés y dividendos por cobrar, neto		40.814.581
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	1.865.001
Ganancia neta no realizada en swaps	2, 10	211.830
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	3.775.010
Otros activos	20	15.716.990
Total de activos		16.332.658.059
Pasivos		
Descubiertos bancarios		(5.438.869)
Opciones vendidas al valor de mercado	2, 12	(7.746)
Pagadero por inversiones adquiridas		(66.351.230)
Reembolsos pagaderos		(37.952.039)
Interés pagadero en swaps	2	(2.846.143)
Dividendo pagadero en swaps	2	(88.207)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(23.082.178)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(11.395.236)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	(195.495)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(13.382.419)
Impuesto por pagar	3	(1.188.617)
Otros pasivos		(2.382.696)
Total de pasivos		(164.310.875)
Total de patrimonio neto		16.168.347.184

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		16.790.747.805
Ingresos		
Dividendos, neto	2	133.967.108
Interés sobre bonos, neto	2	53.621.803
Interés bancario	2	3.334.394
Ingresos por intereses en swaps		7.548.487
Ingresos por intereses en contratos de futuros		663.265
Otros ingresos		30.274
Total de ingresos		199.165.331
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(84.990.004)
Interés bancario	2	(219.321)
Dividendos pagados en swaps		(821.333)
Impuestos extranjeros	3	(1.175.909)
Gastos por intereses en swaps		(11.991.074)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(606.328)
Gastos operativos	3, 5	(14.909.267)
Comisiones varias	4	(17.221)
Total de gastos		(114.730.457)
Ingresos netos de inversiones		84.434.874
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(42.499.489)
Ganancia neta realizada en swaps		3.086.441
(Pérdida) neta realizada en opciones		(146.428)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(3.938.920)
(Pérdida) neta realizada en contratos de futuros		(3.446.883)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(6.812.709)
(Pérdida) neta realizada		(53.757.988)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(258.099.397)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en swaps		(5.973.557)
Cambio en la ganancia neta no realizada en opciones		283.587
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(34.593.566)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		13.052.451
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(285.330.482)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(254.653.596)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		2.092.894.753
Reembolsos de acciones		(2.207.833.238)
Dividendos	7	(29.356.900)
Total de movimientos de capital		(144.295.385)
Diferencias de cambio	2	(224.703.719)
Cambio en las inversiones cruzadas en las Carteras	18	1.252.079
Patrimonio neto al final del periodo		16.168.347.184

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	924.597.235
Efectivo en el banco	2	31.821.228
Por cobrar para la venta de inversiones		6.877.704
Suscripciones por cobrar		343.158
Interés por cobrar en swaps	2	42.755
Interés y dividendos por cobrar, neto		10.468.546
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	1.538.991
Total de activos		975.689.617
Pasivos		
Descubiertos bancarios		(4.787.583)
Pagadero por inversiones adquiridas		(6.574.382)
Reembolsos pagaderos		(775.318)
Interés pagadero en swaps	2	(80.348)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(8.175.655)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(1.438.202)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(241.977)
Otros pasivos		(85.019)
Total de pasivos		(22.158.484)
Total de patrimonio neto		953.531.133

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	1.622.749,535
Clase AEH	1.298.718,103
Clase AKH	70,000
Clase ANH	788,000
Clase AU	921.969,459
Clase AUP	122.803,540
Clase DEC	85.494,157
Clase DEH	191.902,076
Clase DU	200.758,986
Clase DUP	29.303,506
Clase IEC	20.139.050,306
Clase IEH	2.321.053,705
Clase IEP	74,000
Clase IGC	616,000
Clase IGH	1.316.034,462
Clase IKH	80.378,000
Clase INH	785,000
Clase IU	223.514,040
Clase IUP	281.149,363
Clase NEC	497.863,239
Clase NEH	175.426,357
Clase NGC	42.916.981,018
Clase NGH	2.867.553,986
Clase NU	2.004.371,566
Clase NUP	119.344,000
Clase XEH	84,000
Clase XFH	92,000
Clase XGH	9.838.737,914
Clase XU	100,000
Clase XVC	145,000
Clase ZEH	5.515.683,646
Clase ZFH	93,000
Clase ZGH	18.129,173
Clase ZU	397.273,380

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		834.125.305
Ingresos		
Dividendos, neto	2	869.365
Interés sobre bonos, neto	2	16.735.463
Interés bancario	2	434.152
Ingresos por intereses en swaps		1.006.478
Ingresos por intereses en contratos de futuros		180.545
Otros ingresos		252
Total de ingresos		19.226.255
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.415.596)
Interés bancario	2	(53.237)
Gastos por intereses en swaps		(1.346.038)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(274.964)
Gastos operativos	3, 5	(501.697)
Total de gastos		(3.591.532)
Ingresos netos de inversiones		15.634.723
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(9.578.987)
Ganancia neta realizada en swaps		1.113.732
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		10.817.251
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		526.254
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(7.585.634)
(Pérdida) neta realizada		(4.707.384)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(41.942.925)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en swaps		(1.398.593)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(12.565.872)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		2.248.100
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(53.659.290)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(42.731.951)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		226.717.327
Reembolsos de acciones		(51.299.909)
Dividendos	7	(13.279.639)
Total de movimientos de capital		162.137.779
Patrimonio neto al final del periodo		953.531.133

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
USD	953.531.133	834.125.305	512.857.786

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase AEC	8,2646 ¹	8,7274 ¹	9,8883 ¹
Clase AEH	10,0011 ¹	10,3414 ¹	11,3032 ¹
Clase AKH	100,9444 ²	104,4023 ²	113,5556 ²
Clase ANH	9,0854 ³	9,3808 ³	10,1321 ³
Clase AU	11,8071	12,0789	12,8471
Clase AUP	9,8563	10,2933	11,3413
Clase DEC	7,4255 ¹	7,8703 ¹	8,9807 ¹
Clase DEH	9,4286 ¹	9,7853 ¹	10,7729 ¹
Clase DU	10,1338	10,4059	11,1512
Clase DUP	8,6209	9,0388	10,0429
Clase IEC	8,1657 ¹	8,6087 ¹	9,7281 ¹
Clase IEH	10,3200 ¹	10,6546 ¹	11,6146 ¹
Clase IEP	10,1763 ¹	10,3441 ¹	11,0997 ¹
Clase IGC	8,5952 ⁴	8,9969 ⁴	10,0201 ⁴
Clase IGH	11,2771 ⁴	11,5557 ⁴	12,4075 ⁴
Clase IKH	104,0829 ²	107,4977 ²	116,6619 ²
Clase INH	9,1815 ³	9,4739 ³	10,2127 ³
Clase IU	12,1762	12,4379	13,1938
Clase IUP	9,1893	9,5805	10,5391
Clase NEC	8,2563 ¹	8,6991 ¹	9,8160 ¹
Clase NEH	9,4062 ¹	9,7048 ¹	10,5687 ¹
Clase NGC	8,4471 ⁴	8,8347 ⁴	9,8219 ⁴
Clase NGH	9,9686 ⁴	10,2097 ⁴	10,9467 ⁴
Clase NU	10,6209	10,8438	11,4874
Clase NUP	9,2779	9,6764	10,6244
Clase XEH	8,3353 ¹	8,5918 ¹	9,3311 ¹
Clase XFH	8,1595 ⁵	8,4935 ⁵	9,2943 ⁵
Clase XGH	9,8872 ⁴	10,1116 ⁴	10,8105 ⁴
Clase XU	8,7891	8,9631	9,4664
Clase XVC ⁶	9,8651 ⁶	—	—
Clase ZEH	9,4630 ¹	9,7722 ¹	10,6577 ¹
Clase ZFH	8,0346 ⁵	8,3827 ⁵	9,2148 ⁵
Clase ZGH	11,2389 ⁴	11,5218 ⁴	12,3692 ⁴
Clase ZU	12,1504	12,4147	13,1713

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

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

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

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

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

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

⁶ Consulte la nota 1.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	75.233.851
Efectivo en el banco	2	1.496.008
Suscripciones por cobrar		40.808
Interés por cobrar en swaps	2	7.937
Interés y dividendos por cobrar, neto		849.091
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	50.555
Otros activos		6.388
Total de activos		77.684.638
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(558.424)
Reembolsos pagaderos		(1)
Interés pagadero en swaps	2	(13.307)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(204.208)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(189.819)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(19.015)
Otros pasivos		(5.959)
Total de pasivos		(990.733)
Total de patrimonio neto		76.693.905

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	109.010,965
Clase ANH	825,000
Clase IE	618.838,167
Clase IEP	535.456,801
Clase INH	817,000
Clase NE	95,000
Clase NEP	95,000
Clase XE	84,000
Clase XFH	92,000
Clase XGH	72,000
Clase XUH	100,000
Clase ZE	10.456,091
Clase ZFH	175.485,000
Clase 1E	5.895.446,145
Clase 1G	131.768,395
Clase 2E	2.138.298,351
Clase 2G	69,000
Clase 3G	376.185,962
Clase 4E	77,000
Clase 4G	3.046.852,436
Clase 8E	332.824,953
Clase 8G	140.237,899
Clase 9G	70,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		80.133.403
Ingresos		
Interés sobre bonos, neto	2	1.000.207
Interés bancario	2	11.226
Ingresos por intereses en swaps		135.104
Ingresos por intereses en contratos de futuros		8.277
Otros ingresos		1
Total de ingresos		1.154.815
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(125.376)
Gastos por intereses en swaps		(236.843)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(6.020)
Gastos operativos	3, 5	(38.818)
Total de gastos		(407.057)
Ingresos netos de inversiones		747.758
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(1.653.919)
Ganancia neta realizada en swaps		21.142
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(159.011)
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		144.646
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		78.018
(Pérdida) neta realizada		(1.569.124)
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		1.763.937
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en swaps		(99.416)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(286.692)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		155.829
Cambio neto en ganancia no realizada		1.533.658
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		712.292
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		4.760.683
Reembolsos de acciones		(8.846.612)
Dividendos	7	(65.861)
Total de movimientos de capital		(4.151.790)
Patrimonio neto al final del periodo		76.693.905

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
EUR	76.693.905	80.133.403	127.675.204

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase AE	9,3402	9,2779	10,1243
Clase ANH	9,1803 ¹	9,1104 ¹	9,8409 ¹
Clase IE	9,5894	9,5112	10,3374
Clase IEP	8,3002	8,3544	9,2711
Clase INH	9,3573 ¹	9,2841 ¹	9,9943 ¹
Clase NE [#]	9,9637	—	—
Clase NEP [#]	9,9637	—	—
Clase XE	8,9157	8,8344	9,5748
Clase XFH	8,7137 ²	8,7183 ²	9,5292 ²
Clase XGH	9,1893 ³	9,0433 ³	9,6585 ³
Clase XUH	9,3317 ⁴	9,1567 ⁴	9,6777 ⁴
Clase ZE	9,5193	9,4441	10,2805
Clase ZFH	8,5831 ²	8,5999 ²	9,4512 ²
Clase 1E	1,2684	1,2624	1,3811
Clase 1G	1,0127 ³	1,0210 ³	1,0743 ³
Clase 2E	9,5918	9,5174	10,3490
Clase 2G	9,2329 ³	9,2882 ³	9,7243 ³
Clase 3G	1,1492 ³	1,1557 ³	1,2099 ³
Clase 4E	9,7514	9,6587	10,4502
Clase 4G	9,7463 ³	9,7717 ³	10,1679 ³
Clase 8E	1,6059	1,5938	1,7338
Clase 8G	1,3946 ³	1,4020 ³	1,4667 ³
Clase 9G	9,2061 ³	9,2626 ³	9,7021 ³

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

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

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

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

[#] Consulte la nota 1.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	336.773.066
Efectivo en el banco	2	6.958.528
Por cobrar para la venta de inversiones		2.600.660
Suscripciones por cobrar		48.771
Interés y dividendos por cobrar, neto		4.886.462
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	648.148
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	20.898
Total de activos		351.936.533
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(5.882.721)
Reembolsos pagaderos		(9.680.679)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(229.851)
Otros pasivos		(40.710)
Total de pasivos		(15.833.961)
Total de patrimonio neto		336.102.572

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	342,253
Clase AKH	81,000
Clase ANH	807,000
Clase IE	5.328.587,087
Clase IEP	5.525.339,199
Clase IKH	80,000
Clase INH	798,000
Clase XE	77,000
Clase ZE	38.985,677
Clase ZEP	120.094,000
Clase 1E	11.458.547,148
Clase 1EP	974.011,443
Clase 1G	124.695,199
Clase 1GP	3.299,857
Clase 1UT	119.164,536
Clase 2E	30.299,719
Clase 2EP	2.884,000
Clase 2FH	83,000
Clase 2G	68,000
Clase 2GP	75,000
Clase 3E	2.466.982,859
Clase 3EP	1.652.020,683
Clase 3FC	6.523,913
Clase 3FH	27.927,294
Clase 3G	766.013,387
Clase 3GP	31.262,025
Clase 4E	73,000
Clase 4G	65,000
Clase 8E	1.686.221,325
Clase 8EP	3.472.234,874
Clase 8FH	2.926,428
Clase 8G	9.043,481
Clase 8GP	5.021,867
Clase 9E	455.027,353
Clase 9EP	7.573,873
Clase 9FC	92,741
Clase 9FH	83,000
Clase 9G	67,000
Clase 9GP	75,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		402.768.661
Ingresos		
Dividendos, neto	2	1.247
Interés sobre bonos, neto	2	8.146.673
Interés bancario	2	33.174
Ingresos por intereses en contratos de futuros		8.474
Otros ingresos		240
Total de ingresos		8.189.808
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.508.813)
Interés bancario	2	(1.246)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(6.398)
Gastos operativos	3, 5	(257.604)
Total de gastos		(1.774.061)
Ingresos netos de inversiones		6.415.747
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(8.254.253)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(2.786.182)
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		37.425
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		319.919
(Pérdida) neta realizada		(10.683.091)
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		12.044.366
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		1.129.921
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		101.666
Cambio neto en ganancia no realizada		13.275.953
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		9.008.609
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		21.680.929
Reembolsos de acciones		(97.333.504)
Dividendos	7	(22.123)
Total de movimientos de capital		(75.674.698)
Patrimonio neto al final del periodo		336.102.572

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
EUR	336.102.572	402.768.661	437.563.292

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase AE	10,3437	10,1138	10,7825
Clase AKH	97,3526 ¹	95,0769 ¹	101,0117 ¹
Clase ANH	9,9319 ²	9,6834 ²	10,2186 ²
Clase IE	10,5016	10,2265	10,8198
Clase IEP	8,6718	8,4447	9,3088
Clase IKH	100,1913 ¹	97,5060 ¹	102,8317 ¹
Clase INH	10,2227 ²	9,9336 ²	10,4003 ²
Clase XE	10,3256	10,0295	10,5517
Clase ZE	10,4647	10,1957	10,7962
Clase ZEP	8,6419	8,4197	9,2891
Clase 1E	10,1987	9,9677	10,6162
Clase 1EP	8,4201	8,2294	9,1329
Clase 1G	9,8322 ³	9,7341 ³	9,9707 ³
Clase 1GP	8,1410 ³	8,0597 ³	8,6028 ³
Clase 1UT	9,1478 ⁴	9,0587 ⁴	9,8080 ⁴
Clase 2E	10,4924	10,2262	10,8306
Clase 2EP	8,6953	8,4747	9,3488
Clase 2FH	10,1555 ⁵	10,0034 ⁵	10,6851 ⁵
Clase 2G	10,1013 ³	9,9771 ³	10,1723 ³
Clase 2GP	8,4016 ³	8,2855 ³	8,7869 ³
Clase 3E	10,5217	10,2522	10,8528
Clase 3EP	8,7534	8,5292	9,4075
Clase 3FC	8,4426 ⁵	8,3106 ⁵	9,2459 ⁵
Clase 3FH	10,1862 ⁵	10,0264 ⁵	10,7045 ⁵
Clase 3G	10,1428 ³	10,0112 ³	10,1921 ³
Clase 3GP	8,3349 ³	8,2268 ³	8,7267 ³
Clase 4E	10,9007	10,5853	11,1273
Clase 4G	10,7461 ³	10,5718 ³	10,6900 ³
Clase 8E	10,4707	10,2071	10,8147
Clase 8EP	8,6856	8,4670	9,3469
Clase 8FH	10,1368 ⁵	9,9839 ⁵	10,6685 ⁵
Clase 8G	10,0966 ³	9,9700 ³	10,1593 ³
Clase 8GP	8,3565 ³	8,2518 ³	8,7611 ³
Clase 9E	10,5439	10,2702	10,8653
Clase 9EP	8,7755	8,5477	9,4214
Clase 9FC	8,5387 ⁵	8,4020 ⁵	9,3284 ⁵
Clase 9FH	10,2311 ⁵	10,0637 ⁵	10,7239 ⁵
Clase 9G	10,1873 ³	10,0498 ³	10,2232 ³
Clase 9GP	8,4388 ³	8,3237 ³	8,8161 ³

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

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

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

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

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

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

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	62.909.383
Efectivo en el banco	2	3.657.235
Suscripciones por cobrar		22.832
Interés y dividendos por cobrar, neto		813.725
Total de activos		67.403.175
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(478.688)
Reembolsos pagaderos		(33.873)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(37.599)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(14.722)
Otros pasivos		(5.325)
Total de pasivos		(570.207)
Total de patrimonio neto		66.832.968

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	8.608,194
Clase AEP	14.828,250
Clase AKH	82,000
Clase ANH	82,000
Clase IE	346.278,117
Clase IEP	80.700,000
Clase IGC	8,000
Clase IGH	7,000
Clase IKH	82,000
Clase INH	816,000
Clase XE	8,000
Clase XGC	50.662,801
Clase XGH	113.573,645
Clase ZE	8,200

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase AE	104,2880	101,8726	102,3925
Clase AEP	90,8786	88,7739	92,7591
Clase AKH	105,0784 ¹	102,7200 ¹	102,9071 ¹
Clase ANH	107,7914 ²	105,2758 ²	104,6701 ²
Clase IE	106,0567	103,3939	103,5067
Clase IEP	92,4619	90,1405	93,8051
Clase IGC	96,3505 ³	93,3526 ³	95,6430 ³
Clase IGH	109,9179 ³	106,5129 ³	105,1039 ³
Clase IKH	106,2511 ¹	103,6474 ¹	103,4243 ¹
Clase INH	10,8517 ²	10,5733 ²	10,4750 ²
Clase XE	107,8050	104,9403	104,6355
Clase XGC	97,8274 ³	94,5441 ³	96,4461 ³
Clase XGH	112,1259 ³	108,3422 ³	106,2932 ³
Clase ZE	105,6866	103,1073	103,3293

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

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		70.004.869
Ingresos		
Interés sobre bonos, neto	2	1.415.147
Interés bancario	2	7.151
Otros ingresos		16
Total de ingresos		1.422.314
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(87.562)
Interés bancario	2	(1.532)
Gastos operativos	3, 5	(34.910)
Total de gastos		(124.004)
Ingresos netos de inversiones		
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(537.776)
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		345.316
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		61.557
(Pérdida) neta realizada		(130.903)
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		1.342.866
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(72.074)
Cambio neto en ganancia no realizada		1.270.792
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		2.438.199
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		6.293.918
Reembolsos de acciones		(11.904.018)
Total de movimientos de capital		(5.610.100)
Patrimonio neto al final del periodo		66.832.968

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
EUR	66.832.968	70.004.869	108.281.110

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	402.299.547
Efectivo en el banco	2	5.531.754
Por cobrar para la venta de inversiones		394.622
Suscripciones por cobrar		495.217
Interés y dividendos por cobrar, neto		3.746.358
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	392.610
Otros activos		555
Total de activos		412.860.663
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(4.594.838)
Reembolsos pagaderos		(504.773)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(576.496)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(100.799)
Otros pasivos		(38.638)
Total de pasivos		(5.815.544)
Total de patrimonio neto		407.045.119

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	4.021.923,955
Clase AEP	2.436,000
Clase AFH	38.333,000
Clase AKH	86,000
Clase ANH	861,000
Clase ASC	100,000
Clase ASH	100,000
Clase AUC	100,000
Clase AUH	100,000
Clase ID	22.738.015,068
Clase IE	5.915.628,713
Clase IEP	2.569.191,013
Clase IFH	2.654.626,000
Clase IGH	73,000
Clase IKH	85,000
Clase INH	839,000
Clase ISC	100,000
Clase ISH	100,000
Clase IUC	75.457,212
Clase IUH	100,000
Clase LE	3.253.653,783
Clase NEP	118.891,789
Clase ZD	11.948.982,912
Clase ZE	2.383.762,560
Clase ZEP	579.318,140
Clase ZFH	3.489,000
Clase ZGC	6.382.135,133
Clase ZGH	774.871,462
Clase ZUH	100,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		354.723.612
Ingresos		
Interés sobre bonos, neto	2	3.685.608
Interés bancario	2	17.245
Ingresos por intereses en contratos de futuros		115.458
Otros ingresos		124
Total de ingresos		3.818.435
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(594.258)
Interés bancario	2	(4.457)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(91.005)
Gastos operativos	3, 5	(228.353)
Total de gastos		(918.073)
Ingresos netos de inversiones		2.900.362
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(5.269.522)
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		1.519.603
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		727.421
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(171.221)
(Pérdida) neta realizada		(3.193.719)
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		1.948.305
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(935.056)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		1.093.232
Cambio neto en ganancia no realizada		2.106.481
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		1.813.124
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		79.129.118
Reembolsos de acciones		(26.749.619)
Dividendos	7	(1.871.116)
Total de movimientos de capital		50.508.383
Patrimonio neto al final del periodo		407.045.119

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
EUR	407.045.119	354.723.612	397.016.310

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase AE	8,4970	8,4945	9,3388
Clase AEP	8,1565	8,2347	9,1831
Clase AFH	8,3238 ¹	8,4045 ¹	9,3172 ¹
Clase AKH	85,5266 ²	85,5720 ²	93,6342 ²
Clase ANH	8,7103 ³	8,6990 ³	9,4392 ³
Clase ASC	8,4270 ⁴	8,4958 ⁴	9,3030 ⁴
Clase ASH	8,7503 ⁴	8,7327 ⁴	9,4156 ⁴
Clase AUC	8,5544 ⁵	8,5577 ⁵	9,3072 ⁵
Clase AUH	8,8753 ⁵	8,7920 ⁵	9,4257 ⁵
Clase ID	8,6497 ⁶	8,6319 ⁶	9,4617 ⁶
Clase IE	9,1986	9,1890	10,0871
Clase IEP	8,4267	8,5025	9,4700
Clase IFH	8,7714 ¹	8,8540 ¹	9,8039 ¹
Clase IGH	8,7671 ⁷	8,7057 ⁷	9,4189 ⁷
Clase IKH	86,6857 ²	86,7033 ²	94,8504 ²
Clase INH	8,9446 ³	8,9315 ³	9,6877 ³
Clase ISC	8,4780 ⁴	8,5268 ⁴	9,3048 ⁴
Clase ISH	8,7870 ⁴	8,7507 ⁴	9,4173 ⁴
Clase IUC	8,5712 ⁵	8,5688 ⁵	9,3112 ⁵
Clase IUH	8,8934 ⁵	8,8069 ⁵	9,4334 ⁵
Clase LE	9,2272	9,2177	10,1185
Clase NEP	849,7118	857,1354	954,3554
Clase ZD	8,6305 ⁶	8,6148 ⁶	9,4477 ⁶
Clase ZE	9,1641	9,1569	10,0568
Clase ZEP	8,3795	8,4565	9,4219
Clase ZFH	8,7528 ¹	8,8373 ¹	9,7912 ¹
Clase ZGC	8,9004 ⁷	8,9178 ⁷	9,7886 ⁷
Clase ZGH	9,3250 ⁷	9,2550 ⁷	10,0164 ⁷
Clase ZUH	9,1139 ⁵	9,0273 ⁵	9,6718 ⁵

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

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

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

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

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

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

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

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	122.253.592
Efectivo en el banco	2	7.200.354
Por cobrar para la venta de inversiones		2.196.417
Suscripciones por cobrar		121.541
Interés por cobrar en swaps	2	21.605
Interés y dividendos por cobrar, neto		1.473.108
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	4.236
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	370.351
Total de activos		133.641.204
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(4.618.550)
Reembolsos pagaderos		(277.371)
Interés pagadero en swaps	2	(32.453)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(324.937)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(96.368)
Otros pasivos		(18.066)
Total de pasivos		(5.367.745)
Total de patrimonio neto		128.273.459

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	1.846.096,039
Clase AEP	691.429,042
Clase AKH	81,000
Clase ANH	802,000
Clase AUH	1.916,000
Clase DE	948.775,996
Clase DEP	1.317.867,825
Clase DUH	87,000
Clase IE	1.066.204,303
Clase INH	792,000
Clase ZE	85,000

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase AE	28,0092	27,7961	30,0762
Clase AEP	12,8022	12,9611	14,5050
Clase AKH	95,6286 ¹	95,0129 ¹	102,4839 ¹
Clase ANH	9,8109 ²	9,7316 ²	10,4094 ²
Clase AUH	10,9479 ³	10,7647 ³	11,3753 ³
Clase DE	25,8941	25,7676	28,0352
Clase DEP	9,4724	9,6172	10,8231
Clase DUH	10,6266 ³	10,4683 ³	11,1164 ³
Clase IE	28,7368	28,4329	30,5812
Clase INH	10,0847 ²	9,9751 ²	10,6102 ²
Clase ZE	9,0756	8,9875	9,6862

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

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		136.031.975
Ingresos		
Interés sobre bonos, neto	2	2.415.624
Interés bancario	2	72.951
Ingresos por intereses en swaps		328.282
Ingresos por intereses en contratos de futuros		59.697
Otros ingresos		73
Total de ingresos		2.876.627
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(614.961)
Gastos por intereses en swaps		(616.726)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(94.721)
Gastos operativos	3, 5	(115.336)
Total de gastos		(1.441.744)
Ingresos netos de inversiones		
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(2.829.372)
(Pérdida) neta realizada en swaps		(102.186)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(1.051.887)
(Pérdida) neta realizada en contratos de futuros		(675.015)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		32.379
(Pérdida) neta realizada		(4.626.081)
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		2.767.475
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en swaps		(41.970)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		86.116
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		1.401.177
Cambio neto en ganancia no realizada		4.212.798
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		1.021.600
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		5.624.281
Reembolsos de acciones		(13.968.835)
Dividendos	7	(435.562)
Total de movimientos de capital		(8.780.116)
Patrimonio neto al final del periodo		128.273.459

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
EUR	128.273.459	136.031.975	186.513.439

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	33.254.959
Efectivo en el banco	2	3.221.298
Por cobrar para la venta de inversiones		153.890
Suscripciones por cobrar		18.445
Interés y dividendos por cobrar, neto		406.249
Otros activos		260
Total de activos		37.055.101
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(41.610)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(402.958)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(32.213)
Otros pasivos		(4.770)
Total de pasivos		(481.551)
Total de patrimonio neto		36.573.550

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	549.593,185
Clase AEH	231.251,246
Clase AKH	80,000
Clase ANH	792,000
Clase ASH	7.748,647
Clase AU	91.260,842
Clase AUP	694.602,142
Clase DEC	39.015,582
Clase DEH	121.240,188
Clase DU	161.906,709
Clase IEC	280.086,000
Clase IEH	408.917,421
Clase IU	3.906,260
Clase W	6.537,236
Clase WEH	7.298,489
Clase XUP	85,000
Clase ZU	100,000

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase AEC	9,8868 ¹	10,2032 ¹	11,3376 ¹
Clase AEH	19,2282 ¹	19,3369 ¹	20,5319 ¹
Clase AKH	91,3629 ²	91,8018 ²	96,8799 ²
Clase ANH	9,3584 ³	9,3874 ³	9,8352 ³
Clase ASH	13,1636 ⁴	13,2054 ⁴	13,7388 ⁴
Clase AU	21,2771	21,1802	21,9017
Clase AUP	6,6478	6,7900	7,3555
Clase DEC	7,1481 ¹	7,3807 ¹	8,2123 ¹
Clase DEH	14,7264 ¹	14,8160 ¹	15,7465 ¹
Clase DU	16,5392	16,4720	17,0502
Clase IEC	7,6051 ¹	7,8180 ¹	8,6232 ¹
Clase IEH	27,6613 ¹	27,6949 ¹	29,1681 ¹
Clase IU	11,0316	10,9376	11,2198
Clase W	29,3167	29,1323	30,0194
Clase WEH	18,9608 ¹	19,0279 ¹	20,1302 ¹
Clase XUP	9,6671	9,7987	10,5075
Clase ZU	9,0101	8,9259	9,1419

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

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		38.590.481
Ingresos		
Dividendos, neto	2	65.982
Interés sobre bonos, neto	2	830.085
Interés bancario	2	82.189
Otros ingresos		12
Total de ingresos		978.268
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(209.518)
Interés bancario	2	(1.588)
Gastos operativos	3, 5	(31.003)
Total de gastos		(242.109)
Ingresos netos de inversiones		736.159
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(824.721)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(286.621)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(8.610)
(Pérdida) neta realizada		(1.119.952)
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		340.883
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(713.182)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(372.299)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(756.092)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		1.238.294
Reembolsos de acciones		(2.154.244)
Dividendos	7	(344.889)
Total de movimientos de capital		(1.260.839)
Patrimonio neto al final del periodo		36.573.550

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2022	31 de marzo de 2021
USD	36.573.550	38.590.481	40.997.023

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	24.524.094
Efectivo en el banco	2	520.237
Por cobrar para la venta de inversiones		136.624
Suscripciones por cobrar		665
Interés y dividendos por cobrar, neto		354.594
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	12.326
Total de activos		25.548.540
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(7.266)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(28.025)
Otros pasivos		(4.144)
Total de pasivos		(39.435)
Total de patrimonio neto		25.509.105

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	45.132,550
Clase AEH	13.260,391
Clase AKH	82,000
Clase ANH	818,000
Clase ASH	2.362,302
Clase AU	45.276,940
Clase AUP	2.333.327,047
Clase DEH	33.388,025
Clase DU	12.315,260
Clase IEH	8.877,747
Clase IU	89,000
Clase SU	468,170
Clase SUP	39.273,259
Clase W	4.779,568
Clase XUP	89,000
Clase ZU	76,000

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase AEC	6,5615 ¹	6,9476 ¹	8,0881 ¹
Clase AEH	21,7128 ¹	22,3440 ¹	24,6916 ¹
Clase AKH	81,8091 ²	84,1314 ²	92,6360 ²
Clase ANH	8,3574 ³	8,5857 ³	9,3882 ³
Clase ASH	10,5810 ⁴	10,8469 ⁴	11,7200 ⁴
Clase AU	67,5310	68,7292	73,6637
Clase AUP	8,4947	8,8962	10,0463
Clase DEH	16,1030 ¹	16,5765 ¹	18,3325 ¹
Clase DU	47,9043	48,7787	52,3331
Clase IEH	24,2382 ¹	24,8419 ¹	27,2289 ¹
Clase IU	9,4255	9,5573	10,1566
Clase SU	27,0174	27,5181	29,5378
Clase SUP	8,1370	8,5265	9,6466
Clase W	56,7011	57,6066	61,5266
Clase XUP	8,4715	8,8010	9,8204
Clase ZU	11,0242	11,1655	11,8658

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

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		30.398.565
Ingresos		
Dividendos, neto	2	33.464
Interés sobre bonos, neto	2	718.899
Interés bancario	2	22.751
Otros ingresos		11
Total de ingresos		775.125
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(183.904)
Gastos operativos	3, 5	(27.198)
Total de gastos		(211.102)
Ingresos netos de inversiones		564.023
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(804.637)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(80.715)
(Pérdida) neta realizada en contratos de futuros		(26)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(1.283)
(Pérdida) neta realizada		(886.661)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(184.358)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(2.233)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(186.591)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(509.229)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		3.425.201
Reembolsos de acciones		(7.184.200)
Dividendos	7	(621.232)
Total de movimientos de capital		(4.380.231)
Patrimonio neto al final del periodo		25.509.105

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
USD	25.509.105	30.398.565	35.175.906

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

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	50.633.902
Efectivo en el banco	2	2.843.926
Suscripciones por cobrar		432
Interés y dividendos por cobrar, neto		672.899
Otros activos		285
Total de activos		54.151.444
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(68.118)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(343.382)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	(1.561)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(35.601)
Otros pasivos		(6.612)
Total de pasivos		(455.274)
Total de patrimonio neto		53.696.170

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	2.796.078,428
Clase AEH	202.119,146
Clase AKH	85,000
Clase ANH	835,000
Clase ASC	38.888,194
Clase ASH	13.302,932
Clase AU	279.736,087
Clase AUP	1.196.663,285
Clase DEH	75.951,566
Clase DU	110.183,827
Clase IE	188.156,082
Clase IEH	566.147,431
Clase XU	1.221.251,433
Clase XUP	184.900,129
Clase ZEH	7.869,000
Clase ZU	100,000

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase AEC	4,0931 ¹	4,1720 ¹	4,6270 ¹
Clase AEH	13,3182 ¹	13,2333 ¹	13,9674 ¹
Clase AKH	87,6272 ²	87,0471 ²	91,6130 ²
Clase ANH	9,0271 ³	8,9568 ³	9,3476 ³
Clase ASC	5,7387 ⁴	5,8342 ⁴	6,3399 ⁴
Clase ASH	10,2756 ⁴	10,1810 ⁴	10,5249 ⁴
Clase AU	16,9306	16,6480	17,1041
Clase AUP	4,5525	4,5925	4,9572
Clase DEH	10,3369 ¹	10,2791 ¹	10,8662 ¹
Clase DU	13,1284	12,9190	13,2928
Clase IE	10,1309 ¹	9,6716 ¹	9,6301 ¹
Clase IEH	15,4973 ¹	15,3381 ¹	16,0698 ¹
Clase XU	10,7346	10,4820	10,6176
Clase XUP	8,1219	8,1382	8,6646
Clase ZEH	9,9415 ¹	9,8420 ¹	10,3126 ¹
Clase ZU	9,2001	9,0109	9,1782

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

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		59.926.863
Ingresos		
Dividendos, neto	2	82.172
Interés sobre bonos, neto	2	1.325.300
Interés bancario	2	62.291
Ingresos por intereses en contratos de futuros		14.090
Otros ingresos		35
Total de ingresos		1.483.888
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(229.135)
Interés bancario	2	(1.477)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(12.875)
Gastos operativos	3, 5	(43.413)
Total de gastos		(286.900)
Ingresos netos de inversiones		1.196.988
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(1.550.095)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(302.389)
(Pérdida) neta realizada en contratos de futuros		(50.627)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		8.070
(Pérdida) neta realizada		(1.895.041)
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		1.537.192
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(636.341)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de futuros		(45.514)
Cambio neto en ganancia no realizada		855.337
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		157.284
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		1.637.609
Reembolsos de acciones		(7.521.005)
Dividendos	7	(504.581)
Total de movimientos de capital		(6.387.977)
Patrimonio neto al final del periodo		53.696.170

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
USD	53.696.170	59.926.863	91.108.424

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	119.016.604
Efectivo en el banco	2	4.667.041
Suscripciones por cobrar		15.247
Interés y dividendos por cobrar, neto		2.064.281
Total de activos		125.763.173
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(805.119)
Reembolsos pagaderos		(8.373)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(947.223)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(59.403)
Otros pasivos		(10.621)
Total de pasivos		(1.830.739)
Total de patrimonio neto		123.932.434

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	7.372,315
Clase AEH	13.779,949
Clase AKH	80,000
Clase ANH	802,000
Clase ASH	34.577,655
Clase AU	87.284,172
Clase AUP	200.734,788
Clase DEC	11.113,675
Clase DEH	16.084,246
Clase DU	33.346,098
Clase IEC	92,000
Clase IEH	1.899.106,805
Clase IKH	79,000
Clase INH	789,000
Clase ISC	503.383,864
Clase IU	4.420.994,297
Clase TEH	5.146,558
Clase XUP	90,000
Clase ZFH	82,000
Clase ZGH	58,000
Clase ZU	6.851,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		119.687.856
Ingresos		
Interés sobre bonos, neto	2	3.652.627
Interés bancario	2	112.314
Total de ingresos		3.764.941
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(368.933)
Interés bancario	2	(3.668)
Gastos operativos	3, 5	(65.730)
Total de gastos		(438.331)
Ingresos netos de inversiones		3.326.610
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(622.942)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(747.708)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(7.353)
(Pérdida) neta realizada		(1.378.003)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(1.050.117)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(1.674.943)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(2.725.060)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(776.453)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		10.447.900
Reembolsos de acciones		(5.267.795)
Dividendos	7	(159.074)
Total de movimientos de capital		5.021.031
Patrimonio neto al final del periodo		123.932.434

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
USD	123.932.434	119.687.856	176.111.653

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase AEC	10,0040 ¹	10,3123 ¹	11,6239 ¹
Clase AEH	30,0173 ¹	30,0326 ¹	32,0422 ¹
Clase AKH	96,3564 ²	96,4111 ²	102,5833 ²
Clase ANH	9,7858 ³	9,7797 ³	10,3445 ³
Clase ASH	14,5063 ⁴	14,4742 ⁴	15,1131 ⁴
Clase AU	36,9517	36,5811	37,8984
Clase AUP	11,2516	11,4723	12,5588
Clase DEC	7,5198 ¹	7,7584 ¹	8,7567 ¹
Clase DEH	21,5180 ¹	21,5485 ¹	23,0395 ¹
Clase DU	26,4407	26,2017	27,1995
Clase IEC	7,4768 ¹	7,6761 ¹	8,5796 ¹
Clase IEH	30,4580 ¹	30,3547 ¹	32,1076 ¹
Clase IKH	99,7930 ²	99,5072 ²	104,9731 ²
Clase INH	10,1516 ³	10,1091 ³	10,5900 ³
Clase ISC	8,3694 ⁴	8,5672 ⁴	9,3701 ⁴
Clase IU	11,7037	11,5402	11,8564
Clase TEH	10,8727 ¹	10,8358 ¹	11,4601 ¹
Clase XUP	9,5244	9,6526	10,4751
Clase ZFH	10,1409 ⁵	10,2174 ⁵	10,8909 ⁵
Clase ZGH	11,7128 ⁶	11,5898 ⁶	12,0954 ⁶
Clase ZU	13,6078	13,4244	13,8130

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

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

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

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

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

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

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	33.413.229
Efectivo en el banco	2	339.805
Depósitos a plazo	2, 19	1.236.341
Suscripciones por cobrar		707
Interés y dividendos por cobrar, neto		366.140
Otros activos		277
Total de activos		35.356.499
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(36.426)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(227.880)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(10.216)
Otros pasivos		(3.554)
Total de pasivos		(278.076)
Total de patrimonio neto		35.078.423

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	87.279,782
Clase AKH	82,000
Clase AS	1.534,588
Clase ASC	5.715,492
Clase ASH	40.961,628
Clase AU	92.306,146
Clase AUP	477.370,859
Clase AVC	100,000
Clase AVH	100,000
Clase DEH	54.135,624
Clase IEH	1.214.171,903
Clase IGH	54,000
Clase ISH	97,000
Clase IU	41.197,659
Clase XU	1.167.588,452
Clase ZU	70,000
Clase ZUP	92,000

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase AEH	9,9534 ¹	10,2955 ¹	11,1546 ¹
Clase AKH	86,4132 ²	89,4224 ²	96,2683 ²
Clase AS	10,2997 ³	10,2715 ³	11,0373 ³
Clase ASC	8,4500 ³	8,9050 ³	9,8517 ³
Clase ASH	11,2786 ³	11,6360 ³	12,3554 ³
Clase AU	11,6982	11,9774	12,6431
Clase AUP	8,9389	9,3483	10,2865
Clase AVC	8,0036 ⁴	8,4255 ⁴	9,3713 ⁴
Clase AVH	9,8816 ⁴	10,1977 ⁴	10,8855 ⁴
Clase DEH	9,6248 ¹	9,9699 ¹	10,8323 ¹
Clase IEH	10,5320 ¹	10,8634 ¹	11,6988 ¹
Clase IGH	11,4774 ⁵	11,7523 ⁵	12,4646 ⁵
Clase ISH	11,9837 ³	12,3266 ³	13,0166 ³
Clase IU	12,4037	12,6617	13,2854
Clase XU	11,8360	12,0581	12,6016
Clase ZU	12,3901	12,6515	13,2836
Clase ZUP	8,6824	9,0572	9,9161

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

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		43.031.246
Ingresos		
Interés sobre bonos, neto	2	796.610
Interés bancario	2	120.955
Total de ingresos		917.565
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(68.613)
Interés bancario	2	(975)
Gastos operativos	3, 5	(24.392)
Total de gastos		(93.980)
Ingresos netos de inversiones		823.585
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(710.094)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(134.193)
(Pérdida) neta realizada en contratos de futuros		(43)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(3.249)
(Pérdida) neta realizada		(847.579)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(921.090)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(425.274)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(1.346.364)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(1.370.358)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		793.192
Reembolsos de acciones		(7.276.067)
Dividendos	7	(99.590)
Total de movimientos de capital		(6.582.465)
Patrimonio neto al final del periodo		35.078.423

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

USD	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
	35.078.423	43.031.246	57.454.754

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return*

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	28 de abril de 2023*	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase AE	10,8654	10,7963	11,5219
Clase AEP	–	–	11,4169
Clase DE	10,4662	10,4040	11,1869
Clase IE	–	–	11,8436
Clase IEP	–	–	11,7510
Clase LE	–	–	11,9147
Clase LEP	–	–	11,8287
Clase ZE	–	–	11,7517
Clase ZEP	–	–	11,6583

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 al 28 de abril de 2023

	Notas	2023 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		407.907
Ingresos		
Interés sobre bonos, neto	2	271
Interés bancario	2	33
Ingresos por intereses en contratos de futuros		950
Otros ingresos		3.417
Total de ingresos		4.671
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(345)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(501)
Gastos operativos	3, 5	(89)
Total de gastos		(935)
Ingresos netos de inversiones		3.736
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		17.216
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(92.992)
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		351
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		355
(Pérdida) neta realizada		(75.070)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(19.498)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		93.528
Cambio neto en ganancia no realizada		74.030
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		2.696
Movimientos de capital		
Reembolsos de acciones		(410.603)
Total de movimientos de capital		(410.603)
Patrimonio neto al final del periodo		–

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	28 de abril de 2023*	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
EUR	–	407.907	33.700.769

* Consulte la nota 1.

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	30.214.350
Efectivo en el banco	2	1.188.625
Suscripciones por cobrar		861
Interés por cobrar en swaps	2	7.891
Interés y dividendos por cobrar, neto		96.180
Ganancia neta no realizada en swaps	2, 10	155.340
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	248.406
Otros activos	20	9.245
Total de activos		31.920.898
Pasivos		
Descubiertos bancarios		(1.483)
Reembolsos pagaderos		(93.655)
Interés pagadero en swaps	2	(3.946)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(223.344)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(34.773)
Otros pasivos		(7.329)
Total de pasivos		(364.530)
Total de patrimonio neto		31.556.368

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	56.974,888
Clase AEH	272.604,084
Clase AKH	74,000
Clase AU	229.808,214
Clase AUP	262.898,310
Clase DEH	77.571,656
Clase DU	134.997,666
Clase IEH	10.884,928
Clase IGH	24,000
Clase IU	218.107,335
Clase W	5.683,823
Clase ZU	100,000

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase AEC	11,3273 ¹	11,8519 ¹	13,3778 ¹
Clase AEH	24,1178 ¹	24,9127 ¹	27,7017 ¹
Clase AKH	94,3002 ²	97,4964 ²	108,2209 ²
Clase AU	38,2150	39,0428	42,0736
Clase AUP	13,8368	14,3202	15,6687
Clase DEH	17,1260 ¹	17,7549 ¹	19,8712 ¹
Clase DU	24,6430	25,2586	27,3970
Clase IEH	9,6136 ¹	9,8952 ¹	10,9147 ¹
Clase IGH	25,8241 ³	26,3907 ³	28,7174 ³
Clase IU	28,8357	29,3576	31,4158
Clase W	62,7718	64,1635	69,2136
Clase ZU	8,6742	8,8409	9,4818

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

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		35.759.962
Ingresos		
Dividendos, neto	2	136.933
Interés sobre bonos, neto	2	195.140
Interés bancario	2	26.784
Ingresos por intereses en swaps		141.845
Ingresos por intereses en contratos de futuros		17.715
Otros ingresos		3
Total de ingresos		518.420
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(228.240)
Interés bancario	2	(12.316)
Gastos por intereses en swaps		(68.347)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(21.598)
Gastos operativos	3, 5	(48.009)
Total de gastos		(378.510)
Ingresos netos de inversiones		139.910
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		598.809
(Pérdida) neta realizada en swaps		(27.470)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(61.402)
(Pérdida) neta realizada en contratos de futuros		(571.033)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(26.857)
(Pérdida) neta realizada		(87.953)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(1.259.986)
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		58.703
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(406.525)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		563.093
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(1.044.715)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(992.758)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		586.018
Reembolsos de acciones		(3.737.371)
Dividendos	7	(59.483)
Total de movimientos de capital		(3.210.836)
Patrimonio neto al final del periodo		31.556.368

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
USD	31.556.368	35.759.962	44.823.256

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	93.117.042
Efectivo en el banco	2	5.246.903
Por cobrar para la venta de inversiones		685.001
Suscripciones por cobrar		111.326
Interés por cobrar en swaps	2	4.091
Interés y dividendos por cobrar, neto		636.746
Otros activos	20	44.021
Total de activos		99.845.130
Pasivos		
Descubiertos bancarios		(642.011)
Opciones vendidas al valor de mercado	2, 12	(7.746)
Pagadero por inversiones adquiridas		(561.203)
Reembolsos pagaderos		(74.614)
Interés pagadero en swaps	2	(4.543)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(84.009)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(14.589)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	(193.934)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(116.840)
Otros pasivos		(24.341)
Total de pasivos		(1.723.830)
Total de patrimonio neto		98.121.300

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	44.079,450
Clase AEC	4.092.853,820
Clase AEH	518.317,491
Clase AEP	2.256.684,451
Clase AS	100,000
Clase ASC	23.048,382
Clase ASH	639,122
Clase ASP	5.328,176
Clase AU	367.150,590
Clase AUM	15.345,208
Clase AUP	806.944,328
Clase DEC	2.077.493,952
Clase DEH	230.140,021
Clase DEP	195.924,295
Clase DU	327.035,607
Clase DUP	587.799,938
Clase ZE	73,000
Clase ZEC	93,000
Clase ZEH	53.130,970
Clase ZFH	85,000
Clase ZU	4.576,004
Clase ZUP	100,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		109.516.900
Ingresos		
Dividendos, neto	2	677.511
Interés sobre bonos, neto	2	998.607
Interés bancario	2	69.191
Ingresos por intereses en swaps		74.947
Ingresos por intereses en contratos de futuros		141.714
Otros ingresos		18
Total de ingresos		1.961.988
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(766.840)
Interés bancario	2	(11.068)
Gastos por intereses en swaps		(81.919)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(67.361)
Gastos operativos	3, 5	(159.562)
Total de gastos		(1.086.750)
Ingresos netos de inversiones		875.238
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		2.776
Ganancia neta realizada en swaps		13.881
(Pérdida) neta realizada en opciones		(146.428)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(858.934)
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		817.615
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(233.459)
(Pérdida) neta realizada		(404.549)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(3.459.247)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en swaps		(8.859)
Cambio en la ganancia neta no realizada en opciones		283.587
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(189.836)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de futuros		(560.345)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(3.934.700)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(3.464.011)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		4.343.905
Reembolsos de acciones		(10.288.427)
Dividendos	7	(1.987.067)
Total de movimientos de capital		(7.931.589)
Patrimonio neto al final del periodo		98.121.300

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
USD	98.121.300	109.516.900	142.600.557

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase AE	11,6977 ¹	11,5541 ¹	11,8451 ¹
Clase AEC	6,5098 ¹	6,8440 ¹	7,7505 ¹
Clase AEH	16,1523 ¹	16,5540 ¹	17,9084 ¹
Clase AEP	8,6546 ¹	8,7671 ¹	9,4049 ¹
Clase AS	10,5742 ²	10,4496 ²	11,1952 ²
Clase ASC	7,8606 ²	8,2370 ²	9,1249 ²
Clase ASH	10,2491 ²	10,4766 ²	11,0880 ²
Clase ASP	8,0628 ²	8,1638 ²	9,1289 ²
Clase AU	19,2920	19,5536	20,5295
Clase AUM	8,5277	8,8613	9,7159
Clase AUP	8,0525	8,3706	9,1953
Clase DEC	6,0799 ¹	6,4163 ¹	7,3229 ¹
Clase DEH	9,0938 ¹	9,3527 ¹	10,1960 ¹
Clase DEP	8,0194 ¹	8,1540 ¹	8,8122 ¹
Clase DU	11,7243	11,9278	12,6175
Clase DUP	7,2242	7,5370	8,3429
Clase ZE	12,0675 ¹	11,8898 ¹	12,1429 ¹
Clase ZEC	7,2418 ¹	7,6027 ¹	8,5885 ¹
Clase ZEH	9,8509 ¹	10,0654 ¹	10,8301 ¹
Clase ZFH	9,5170 ³	9,8346 ³	10,6752 ³
Clase ZU	11,3883	11,5140	12,0281
Clase ZUP	8,1549	8,4589	9,2576

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

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

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

Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities*

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	21 de julio de 2023*	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase AE	–	8,6814 ¹	10,1300 ¹
Clase AEC	–	7,3738 ¹	9,3082 ¹
Clase AEH	7,9706 ¹	7,6264 ¹	9,4264 ¹
Clase AU	–	8,0834	9,6534
Clase AUP	–	7,8220	9,5286
Clase IE	–	8,8953 ¹	10,2725 ¹
Clase IEH	–	7,8154 ¹	9,5604 ¹
Clase IG	–	8,5458 ²	9,4923 ²
Clase IU	–	8,2860	9,7979
Clase LE	9,2674 ¹	8,9650 ¹	10,3264 ¹
Clase LG	–	8,6130 ²	9,5344 ²
Clase XU	–	8,4163	9,8914
Clase ZE	–	8,8591 ¹	10,2464 ¹
Clase ZEC	–	7,5103 ¹	9,4153 ¹
Clase ZEH	–	7,7713 ¹	9,5353 ¹
Clase ZU	8,6966	8,2349	9,7613
Clase ZUP	–	7,9637	9,6378

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

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

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 21 de julio de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		5.136.196
Ingresos		
Dividendos, neto	2	45.573
Interés bancario	2	5.668
Total de ingresos		51.241
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(10.047)
Gastos operativos	3, 5	(2.250)
Total de gastos		(12.297)
Ingresos netos de inversiones		38.944
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(348.318)
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		3.144
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(7.537)
(Pérdida) neta realizada		(352.711)
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		608.642
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(816)
Cambio neto en ganancia no realizada		607.826
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		294.059
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		43.105
Reembolsos de acciones		(5.473.360)
Total de movimientos de capital		(5.430.255)
Patrimonio neto al final del periodo		–

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	21 de julio de 2023*	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
USD	–	5.136.196	6.094.426

* Consulte la nota 1.

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Focus

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	2.062.603.845
Efectivo en el banco	2	7.129.430
Por cobrar para la venta de inversiones		26.822.912
Suscripciones por cobrar		2.665.685
Interés y dividendos por cobrar, neto		1.314.315
Otros activos	20	874.803
Total de activos		2.101.410.990
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(1.433.935)
Reembolsos pagaderos		(14.826.380)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(2.967.338)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(1.948.864)
Otros pasivos		(270.208)
Total de pasivos		(21.446.725)
Total de patrimonio neto		2.079.964.265

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	1.532.548,719
Clase AEP	4.475.550,131
Clase ASH	183.431,053
Clase AU	8.468.866,163
Clase AUP	36.528,652
Clase DEH	636.715,165
Clase DU	1.576.861,531
Clase IE	6.443.637,840
Clase IEH	3.834.422,649
Clase IU	23.242.631,292
Clase IUP	51.939,864
Clase W	4.738,351
Clase XU	4.860.841,734
Clase ZE	4.900.593,870
Clase ZEH	243.039,099
Clase ZEP	3.818.428,619
Clase ZFH	75,000
Clase ZG	53.624,550
Clase ZU	679.712,556

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		1.861.595.403
Ingresos		
Dividendos, neto	2	12.361.181
Interés bancario	2	155.442
Otros ingresos		926
Total de ingresos		12.517.549
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(11.794.022)
Interés bancario	2	(37.492)
Gastos operativos	3, 5	(1.625.457)
Total de gastos		(13.456.971)
(Pérdida) neta de inversiones		(939.422)
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		23.961.706
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(2.521.247)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		1.081.167
Ganancia neta realizada		22.521.626
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(3.152.622)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(4.836.702)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(7.989.324)
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		13.592.880
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		520.987.037
Reembolsos de acciones		(314.790.568)
Dividendos	7	(1.420.487)
Total de movimientos de capital		204.775.982
Patrimonio neto al final del periodo		2.079.964.265

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
USD	2.079.964.265	1.861.595.403	2.405.094.415

Threadneedle (Lux) - Global Focus

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase AEH	52,8149 ¹	52,8087 ¹	60,3566 ¹
Clase AEP	20,1797 ¹	19,5948 ¹	21,3430 ¹
Clase ASH	10,0139 ²	9,9814 ²	–
Clase AU	94,4807	93,4160	102,8279
Clase AUP	14,6818	14,6282	16,3197
Clase DEH	37,4250 ¹	37,5629 ¹	43,2512 ¹
Clase DU	48,1996	47,8351	53,0512
Clase IE	20,3319 ¹	19,5074 ¹	20,7896 ¹
Clase IEH	14,5232 ¹	14,4633 ¹	16,3912 ¹
Clase IU	19,7083	19,4038	21,1779
Clase IUP	15,3518	15,2319	16,8469
Clase W	144,5928	142,8921	157,1578
Clase XU	23,3306	22,8844	24,7993
Clase ZE	22,8824 ¹	21,9599 ¹	23,4189 ¹
Clase ZEH	10,4462 ¹	10,4027 ¹	11,7932 ¹
Clase ZEP	21,1818 ¹	20,4842 ¹	22,1355 ¹
Clase ZFH	10,2500 ³	10,3229 ³	11,7503 ³
Clase ZG	23,1850 ⁴	22,5389 ⁴	23,1166 ⁴
Clase ZU	23,8234	23,4612	25,6233

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

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

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

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

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	333.906.028
Efectivo en el banco	2	2.494.806
Por cobrar para la venta de inversiones		1.214.493
Suscripciones por cobrar		68.528
Interés y dividendos por cobrar, neto		373.905
Otros activos	20	27.291
Total de activos		338.085.051
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(1.223.459)
Reembolsos pagaderos		(4.503)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(19.486)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(61.425)
Impuesto por pagar	3	(937.698)
Otros pasivos		(28.257)
Total de pasivos		(2.274.828)
Total de patrimonio neto		335.810.223

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	14.848,168
Clase AU	31.070,695
Clase DEH	49.249,291
Clase DU	56.875,784
Clase IE	19.001,452
Clase IEH	4.419,305
Clase IU	4.747.899,224
Clase XU	29.384.764,597
Clase ZU	127.145,678
Clase 1E	2.994.520,174
Clase 1U	1.925.696,484
Clase 2E	1.586.097,894
Clase 2U	53,000
Clase 8E	390,015
Clase 8U	1.633.726,373

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase AEH	23,5737 ¹	24,5593 ¹	29,8455 ¹
Clase AU	40,5229	41,7317	48,9816
Clase DEH	16,4870 ¹	17,2383 ¹	21,1131 ¹
Clase DU	27,8276	28,7652	34,0169
Clase IE	10,4279 ¹	10,4209 ¹	11,8421 ¹
Clase IEH	14,5022 ¹	15,0434 ¹	18,1198 ¹
Clase IU	9,8590	10,1101	11,7660
Clase XU	8,6890	8,8771	10,2512
Clase ZU	9,4213	9,6637	11,2539
Clase 1E	1,2390 ¹	1,2435 ¹	1,4248 ¹
Clase 1U	1,3116	1,3508	1,5851
Clase 2E	11,4917 ¹	11,4983 ¹	13,0947 ¹
Clase 2U	10,7321	11,0215	12,8579
Clase 8E	1,3718 ¹	1,3737 ¹	1,5656 ¹
Clase 8U	1,4539	1,4931	1,7421

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

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		353.705.997
Ingresos		
Dividendos, neto	2	4.121.794
Interés bancario	2	117.484
Otros ingresos		2.048
Total de ingresos		4.241.326
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(412.786)
Interés bancario	2	(3.804)
Impuestos extranjeros	3	(935.985)
Gastos operativos	3, 5	(182.859)
Comisiones varias	4	(44)
Total de gastos		(1.535.478)
Ingresos netos de inversiones		2.705.848
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(15.323.652)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(22.075)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(152.393)
(Pérdida) neta realizada		(15.498.120)
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		5.575.200
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(40.212)
Cambio neto en ganancia no realizada		5.534.988
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(7.257.284)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		3.530.643
Reembolsos de acciones		(14.169.133)
Total de movimientos de capital		(10.638.490)
Patrimonio neto al final del periodo		335.810.223

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
USD	335.810.223	353.705.997	134.106.881

Threadneedle (Lux) - Global Equity Income

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	153.620.720
Efectivo en el banco	2	2.760.287
Suscripciones por cobrar		71.280
Interés y dividendos por cobrar, neto		246.018
Otros activos	20	191.398
Total de activos		156.889.703
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(115.547)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(12.614)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(129.648)
Otros pasivos		(21.912)
Total de pasivos		(279.721)
Total de patrimonio neto		156.609.982

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	1.351,515
Clase AUP	84,000
Clase DEC	77,000
Clase DUP	50.332,985
Clase IU	75,000
Clase TE	66,000
Clase ZU	75,000
Clase 1E	1.569.125,530
Clase 1EP	1.356.190,470
Clase 1SC	394.376,055
Clase 1SH	32.392,458
Clase 1ST	44.487,111
Clase 1U	290.601,013
Clase 1UP	377.636,827
Clase 1VT	5.380,054
Clase 2E	796.323,769
Clase 2EP	72,000
Clase 2U	75,000
Clase 2UP	82,000
Clase 3E	130.052,948
Clase 3EP	7.301.029,114
Clase 3U	12.575,003
Clase 3UP	20.181,726
Clase 8E	89.835,664
Clase 8EP	236,808
Clase 8U	2.814,090
Clase 8UP	105.481,704
Clase 9E	65,000
Clase 9EP	72,000
Clase 9U	74,000
Clase 9UP	82,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		168.397.015
Ingresos		
Dividendos, neto	2	2.600.922
Interés bancario	2	19.754
Total de ingresos		2.620.676
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(840.404)
Gastos operativos	3, 5	(141.855)
Total de gastos		(982.259)
Ingresos netos de inversiones		1.638.417
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		4.143.991
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(68.565)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(50.258)
Ganancia neta realizada		4.025.168
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(10.486.366)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(66.781)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(10.553.147)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(4.889.562)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		8.054.390
Reembolsos de acciones		(12.739.829)
Dividendos	7	(2.212.032)
Total de movimientos de capital		(6.897.471)
Patrimonio neto al final del periodo		156.609.982

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
USD	156.609.982	168.397.015	215.918.713

Threadneedle (Lux) - Global Equity Income

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase AEC	9,1532 ¹	9,7529 ¹	10,9032 ¹
Clase AUP	10,3211	10,8746	11,7207
Clase DEC	8,9170 ¹	9,5329 ¹	10,7205 ¹
Clase DUP	10,0710	10,6321	11,5104
Clase IU	12,6640	13,0416	13,5078
Clase TE	13,6317 ¹	13,6889 ¹	13,8508 ¹
Clase ZU	12,6161	12,9971	13,4839
Clase 1E	13,2582 ¹	13,3500 ¹	13,6005 ¹
Clase 1EP	11,2684 ¹	11,5606 ¹	12,1468 ¹
Clase 1SC	9,9143 ²	10,5266 ²	11,4630 ²
Clase 1SH	11,6796 ²	12,1716 ²	12,8545 ²
Clase 1ST	9,9376 ²	10,5621 ²	11,4849 ²
Clase 1U	12,2522	12,6598	13,2084
Clase 1UP	10,3961	10,9443	11,7772
Clase 1VT	9,4832 ³	10,0908 ³	11,1290 ³
Clase 2E	13,9147 ¹	13,9684 ¹	14,1440 ¹
Clase 2EP	11,6364 ¹	11,9014 ¹	12,4187 ¹
Clase 2U	12,6181	13,0009	13,4831
Clase 2UP	10,7573	11,2898	12,0644
Clase 3E	13,7578 ¹	13,8013 ¹	13,9552 ¹
Clase 3EP	11,6972 ¹	11,9519 ¹	12,4603 ¹
Clase 3U	12,7138	13,0876	13,5528
Clase 3UP	10,8218	11,3470	12,1163
Clase 8E	13,6306 ¹	13,6859 ¹	13,8635 ¹
Clase 8EP	11,5677 ¹	11,8295 ¹	12,3593 ¹
Clase 8U	12,5997	12,9818	13,4674
Clase 8UP	10,7129	11,2439	12,0275
Clase 9E	13,8145 ¹	13,8492 ¹	13,9945 ¹
Clase 9EP	11,7464 ¹	11,9987 ¹	12,4988 ¹
Clase 9U	12,7812	13,1489	13,6064
Clase 9UP	10,8557	11,3777	12,1372

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

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

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

Threadneedle (Lux) - Global Select

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	501.806.964
Efectivo en el banco	2	2.009.198
Suscripciones por cobrar		3.617.541
Interés y dividendos por cobrar, neto		418.321
Otros activos	20	218.089
Total de activos		508.070.113
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(303.923)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(500.385)
Otros pasivos		(58.894)
Total de pasivos		(863.202)
Total de patrimonio neto		507.206.911

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase IU	105.401,441
Clase ZU	1.378,995
Clase 1E	2.831.615,749
Clase 1U	59.123.604,645
Clase 2E	987.544,737
Clase 2U	2.674.988,914
Clase 3U	8.260.028,110
Clase 8E	59.566,592
Clase 8U	23.145.385,060
Clase 9U	2.380.198,476

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase IU	14,5539	13,9844	15,7040
Clase ZU	14,5074	13,9429	15,6678
Clase 1E	3,7330 ¹	3,5100 ¹	3,8796 ¹
Clase 1U	3,9518	3,8129	4,3160
Clase 2E	15,5909 ¹	14,6149 ¹	16,0460 ¹
Clase 2U	14,4639	13,9132	15,6533
Clase 3U	4,2668	4,1009	4,6059
Clase 8E	5,5290 ¹	5,1839 ¹	5,6972 ¹
Clase 8U	5,8528	5,6311	6,3379
Clase 9U	14,6070	14,0355	15,7566

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

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		572.766.407
Ingresos		
Dividendos, neto	2	4.055.807
Interés bancario	2	60.899
Otros ingresos		13
Total de ingresos		4.116.719
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(3.182.523)
Interés bancario	2	(22)
Gastos operativos	3, 5	(377.247)
Total de gastos		(3.559.792)
Ingresos netos de inversiones		556.927
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		15.122.983
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		15.792
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(567.999)
Ganancia neta realizada		14.570.776
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		4.618.330
Cambio neto en ganancia no realizada		4.618.330
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		19.746.033
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		32.160.889
Reembolsos de acciones		(117.466.418)
Total de movimientos de capital		(85.305.529)
Patrimonio neto al final del periodo		507.206.911

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
USD	507.206.911	572.766.407	609.163.562

Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	1.683.404.846
Efectivo en el banco	2	2.506.312
Suscripciones por cobrar		2.201.917
Interés y dividendos por cobrar, neto		1.845.337
Otros activos	20	548.411
Total de activos		1.690.506.823
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(5.830.761)
Reembolsos pagaderos		(2.920.178)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(297.342)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(1.570.934)
Otros pasivos		(362.754)
Total de pasivos		(10.981.969)
Total de patrimonio neto		1.679.524.854

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	14.712.687,749
Clase AEP	23.499.879,078
Clase AK	996.330,341
Clase AUP	66.211,330
Clase DE	1.787.757,724
Clase IE	5.293.392,143
Clase IEP	1.634.158,045
Clase IG	8.860,000
Clase NE	6.544.381,000
Clase XE	1.529.301,228
Clase XFH	2.475.977,508
Clase XG	41,000
Clase XGH	30,000
Clase XU	6.850.571,548
Clase ZE	3.866.902,294
Clase ZFH	353.470,539
Clase ZG	1.905.957,625
Clase ZGH	64.296,954
Clase ZU	5.248.346,019

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		1.686.572.705
Ingresos		
Dividendos, neto	2	10.236.933
Interés bancario	2	70.730
Otros ingresos		1.603
Total de ingresos		10.309.266
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(9.897.017)
Interés bancario	2	(330)
Gastos operativos	3, 5	(2.272.152)
Total de gastos		(12.169.499)
(Pérdida) neta de inversiones		(1.860.233)
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(51.659.904)
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		600.359
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(14.751)
(Pérdida) neta realizada		(51.074.296)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(2.332.039)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(243.355)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(2.575.394)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(55.509.923)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		224.508.094
Reembolsos de acciones		(176.046.022)
Total de movimientos de capital		48.462.072
Patrimonio neto al final del periodo		1.679.524.854

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

30 de septiembre de 2023 31 de marzo de 2023 31 de marzo de 2022

EUR 1.679.524.854 1.686.572.705 1.892.718.184

Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase AE	40,8905	42,3307	45,6690
Clase AEP	13,2494	13,7161	14,9359
Clase AK	123,1411 ¹	124,8571 ¹	123,9807 ¹
Clase AUP	11,9109 ²	12,6530 ²	14,1101 ²
Clase DE	30,7950	31,9592	34,6525
Clase IE	60,4960	62,3619	66,7097
Clase IEP	11,3861	11,7372	12,6727
Clase IG [†]	9,5519 ³	–	–
Clase NE	13,3356	13,7328	14,6609
Clase XE	15,6049	16,0222	17,0020
Clase XFH	10,1251 ⁴	10,5007 ⁴	11,2077 ⁴
Clase XG	15,4336 ³	16,0392 ³	16,3517 ³
Clase XGH	21,6391 ³	22,0720 ³	23,1206 ³
Clase XU	9,2375 ²	9,7326 ²	10,5772 ²
Clase ZE	14,8583	15,3242	16,4090
Clase ZFH	14,3705 ⁴	14,9779 ⁴	16,1495 ⁴
Clase ZG	14,6885 ³	15,3455 ³	15,8031 ³
Clase ZGH	44,0943 ³	45,1878 ³	47,7950 ³
Clase ZU	13,3386 ²	14,1168 ²	15,4806 ²

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

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

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

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

[†] Consulte la nota 1.

Threadneedle (Lux) - American

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	997.042.817
Efectivo en el banco	2	5.943.638
Suscripciones por cobrar		354.482
Interés y dividendos por cobrar, neto		732.631
Total de activos		1.004.073.568
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(377.668)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(3.173.357)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(891.685)
Otros pasivos		(160.662)
Total de pasivos		(4.603.372)
Total de patrimonio neto		999.470.196

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	2.263.447,279
Clase AU	255.132,519
Clase DEH	42.663,041
Clase DU	560.513,229
Clase IEH	559.601,946
Clase IU	5.069.359,262
Clase W	1.598,035
Clase ZE	16.913,726
Clase ZEH	2.029.188,332
Clase ZU	60,000
Clase 1E	2.415.210,626
Clase 1EH	60.875,054
Clase 1EP	297.527,041
Clase 1U	11.577.163,706
Clase 2E	562.431,422
Clase 2U	7.774.245,443
Clase 3EH	55,000
Clase 3U	138.232,241
Clase 8E	381.351,179
Clase 8U	535.183,227
Clase 9EH	55,000
Clase 9U	361.158,912

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		1.058.036.962
Ingresos		
Dividendos, neto	2	5.966.283
Interés bancario	2	112.014
Total de ingresos		6.078.297
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(5.730.637)
Interés bancario	2	(11.547)
Gastos operativos	3, 5	(1.035.047)
Total de gastos		(6.777.231)
(Pérdida) neta de inversiones		(698.934)
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		1.953.102
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(2.747.789)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(99.754)
(Pérdida) neta realizada		(894.441)
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		108.957
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(5.089.249)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(4.980.292)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(6.573.667)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		35.423.171
Reembolsos de acciones		(87.416.270)
Total de movimientos de capital		(51.993.099)
Patrimonio neto al final del periodo		999.470.196

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
USD	999.470.196	1.058.036.962	1.241.417.577

Threadneedle (Lux) - American

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase AEH	57,9369 ¹	58,8005 ¹	67,7231 ¹
Clase AU	106,0676	106,4713	118,2788
Clase DEH	42,4760 ¹	43,1697 ¹	49,9448 ¹
Clase DU	40,8994	41,1268	45,8481
Clase IEH	63,8464 ¹	64,4833 ¹	73,6686 ¹
Clase IU	74,0201	73,9691	81,4356
Clase W	142,1845	142,5123	157,8424
Clase ZE	16,9089 ¹	16,4747 ¹	17,7345 ¹
Clase ZEH	13,5579 ¹	13,7004 ¹	15,6669 ¹
Clase ZU	15,4510	15,4537	17,0528
Clase 1E	16,0347 ¹	15,6752 ¹	16,9814 ¹
Clase 1EH	13,0427 ¹	13,2250 ¹	15,2219 ¹
Clase 1EP	14,9868 ¹	14,6508 ¹	16,1234 ¹
Clase 1U	14,6617	14,7080	16,3179
Clase 2E	16,5316 ¹	16,1119 ¹	17,3483 ¹
Clase 2U	15,1137	15,1153	16,6678
Clase 3EH	13,5544 ¹	13,6917 ¹	15,6415 ¹
Clase 3U	15,2492	15,2372	16,7719
Clase 8E	16,4972 ¹	16,0815 ¹	17,3225 ¹
Clase 8U	15,0792	15,0839	16,6398
Clase 9EH	13,5958 ¹	13,7283 ¹	15,6785 ¹
Clase 9U	15,2731	15,2580	16,7881

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

Threadneedle (Lux) - American Select

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	307.049.258
Efectivo en el banco	2	3.151.510
Depósitos a plazo	2, 19	4.220.003
Suscripciones por cobrar		32.941
Interés y dividendos por cobrar, neto		159.903
Otros activos		397
Total de activos		314.614.012
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(173.036)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(20.178)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(380.198)
Otros pasivos		(44.752)
Total de pasivos		(618.164)
Total de patrimonio neto		313.995.848

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AD	405,000
Clase AEH	14.686,119
Clase AN	524,000
Clase AU	121.616,389
Clase DEH	14.148,898
Clase DU	83.135,599
Clase ID	399,000
Clase IE	701.506,073
Clase IEH	4.747,315
Clase IN	517,000
Clase W	4.061,651
Clase ZEH	53,000
Clase ZU	11.000,804
Clase 1E	11.632.688,492
Clase 1EH	48.303,016
Clase 1EP	413.956,113
Clase 1U	36.013.189,855
Clase 2EH	712,000
Clase 2U	57,000
Clase 3E	776.462,597
Clase 3U	749.922,813
Clase 8EH	4.562,812
Clase 8U	135.792,858
Clase 9E	50,000
Clase 9U	4.596,724

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		336.747.052
Ingresos		
Dividendos, neto	2	1.559.909
Interés bancario	2	160.557
Total de ingresos		1.720.466
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(2.444.382)
Gastos operativos	3, 5	(282.862)
Total de gastos		(2.727.244)
(Pérdida) neta de inversiones		(1.006.778)
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(3.563.888)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(11.791)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		11.212
(Pérdida) neta realizada		(3.564.467)
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		1.387.170
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(36.765)
Cambio neto en ganancia no realizada		1.350.405
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(3.220.840)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		18.568.574
Reembolsos de acciones		(38.098.938)
Total de movimientos de capital		(19.530.364)
Patrimonio neto al final del periodo		313.995.848

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
USD	313.995.848	336.747.052	413.688.020

Threadneedle (Lux) - American Select

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase AD	14,631 ¹	14,418 ¹	16,100 ¹
Clase AEH	35,576 ²	36,389 ²	43,261 ²
Clase AN	17,082 ³	17,019 ³	16,272 ³
Clase AU	34,544	34,951	39,988
Clase DEH	23,886 ²	24,524 ²	29,364 ²
Clase DU	29,892	30,357	34,997
Clase ID	15,160 ¹	14,871 ¹	16,450 ¹
Clase IE	15,179 ²	14,905 ²	16,515 ²
Clase IEH	38,498 ²	39,227 ²	46,265 ²
Clase IN	17,684 ³	17,536 ³	16,610 ³
Clase W	36,580	37,001	42,313
Clase ZEH	12,926 ²	13,187 ²	15,578 ²
Clase ZU	14,793	14,915	16,945
Clase 1E	5,620 ¹	5,537 ²	6,178 ²
Clase 1EH	3,781 ²	3,866 ³	4,589 ²
Clase 1EP	5,332 ²	5,254 ²	5,957 ²
Clase 1U	5,950	6,016	6,874
Clase 2EH	13,397 ²	13,655 ²	16,111 ²
Clase 2U	15,031	15,147	17,203
Clase 3E	4,667 ²	4,581 ²	5,070 ²
Clase 3U	4,949	4,970	5,645
Clase 8EH	3,362 ²	3,427 ²	4,045 ²
Clase 8U	6,938	6,995	7,940
Clase 9E	16,301 ²	15,999 ²	17,712 ²
Clase 9U	15,207	15,312	17,350

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

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

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

Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	566.740.126
Efectivo en el banco	2	2.574.907
Suscripciones por cobrar		977.048
Interés y dividendos por cobrar, neto		151.092
Total de activos		570.443.173
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(341.458)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(1.695.463)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(447.225)
Otros pasivos		(84.804)
Total de pasivos		(2.568.950)
Total de patrimonio neto		567.874.223

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	199.326,519
Clase AEH	169.804,620
Clase ASH	135,000
Clase AU	60.005,096
Clase DEH	21.247,172
Clase DU	268.305,589
Clase IE	10.351.864,842
Clase IFH	2.287.119,150
Clase IU	2.888.369,618
Clase NE	95,000
Clase ZE	134.567,764
Clase ZU	69.747,474
Clase 1E	596.894,753
Clase 1EP	1.141.238,643
Clase 1U	6.118.454,034
Clase 2U	1.463.640,198
Clase 3EH	4.009,863
Clase 3U	872.967,852
Clase 8U	1.198.540,017
Clase 9EH	4.093.929,694
Clase 9U	2.410.065,481

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		461.159.186
Ingresos		
Dividendos, neto	2	2.778.860
Interés bancario	2	79.513
Total de ingresos		2.858.373
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(2.554.445)
Interés bancario	2	(5.305)
Gastos operativos	3, 5	(450.278)
Total de gastos		(3.010.028)
(Pérdida) neta de inversiones		(151.655)
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		7.548.149
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(1.191.067)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(160.549)
Ganancia neta realizada		6.196.533
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(14.314.461)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(2.389.604)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(16.704.065)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(10.659.187)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		193.914.664
Reembolsos de acciones		(76.540.440)
Total de movimientos de capital		117.374.224
Patrimonio neto al final del periodo		567.874.223

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
USD	567.874.223	461.159.186	336.365.358

Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase AE [#]	10,4566 ¹	–	–
Clase AEH	14,4408 ¹	14,5673 ¹	16,5581 ¹
Clase ASH	9,6759 ²	9,7371 ²	–
Clase AU	16,2695	16,2313	17,7793
Clase DEH	14,0840 ¹	14,2416 ¹	16,2757 ¹
Clase DU	15,8799	15,8822	17,4841
Clase IE	16,6557 ¹	16,1245 ¹	17,1002 ¹
Clase IFH [#]	10,1061 ³	–	–
Clase IU	16,9699	16,8585	18,3099
Clase NE [#]	9,8724 ¹	–	–
Clase ZE [#]	10,4944 ¹	–	–
Clase ZU	16,9012	16,7987	18,2631
Clase 1E	17,7491 ¹	17,2458 ¹	18,4235 ¹
Clase 1EP	16,6042 ¹	16,1333 ¹	17,4744 ¹
Clase 1U	16,3812	16,3330	17,8692
Clase 2U	16,8824	16,7817	18,2483
Clase 3EH	15,1170 ¹	15,1814 ¹	17,0721 ¹
Clase 3U	16,9954	16,8822	18,3319
Clase 8U	16,8570	16,7598	18,2318
Clase 9EH	15,1433 ¹	15,2029 ¹	17,1199 ¹
Clase 9U	17,0344	16,9176	18,3630

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

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

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

[#] Consulte la nota 1.

Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	8.963.485
Efectivo en el banco	2	235.328
Interés y dividendos por cobrar, neto		14.382
Total de activos		9.213.195
Pasivos		
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(751)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(1.008)
Impuesto por pagar	3	(10.557)
Otros pasivos		(1.216)
Total de pasivos		(13.532)
Total de patrimonio neto		9.199.663

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	1.735,856
Clase AF	51,000
Clase AS	938,481
Clase ASH	24.311,997
Clase AU	9.092,649
Clase DE	24.208,451
Clase IF	49,000
Clase ISH	71,000
Clase IU	51,000
Clase XU	864.711,052
Clase XUP	59,000
Clase ZE	45,000
Clase ZEH	49,000
Clase ZF	49,000
Clase ZG	60,000
Clase ZU	4.199,804

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase AE	12,7955 ¹	13,9231 ¹	15,4485 ¹
Clase AF	11,3871 ²	12,7109 ²	14,5713 ²
Clase AS	9,1384 ³	9,9397 ³	11,4961 ³
Clase ASH	10,9809 ³	12,3807 ³	14,2590 ³
Clase AU	11,8227	13,2011	15,0003
Clase DE	11,9734 ¹	13,0775 ¹	14,6194 ¹
Clase IF	12,2057 ²	13,5353 ²	15,3389 ²
Clase ISH	11,8889 ³	13,3286 ³	15,2033 ³
Clase IU	12,7524	14,1624	15,9526
Clase XU	9,8310	10,8872	12,1685
Clase XUP	10,3412	11,7028	13,4480
Clase ZE	13,5688 ¹	14,7099 ¹	16,2137 ¹
Clase ZEH	10,5646 ¹	11,8918 ¹	13,8883 ¹
Clase ZF	12,1161 ²	13,4629 ²	15,3088 ²
Clase ZG	8,8053 ⁴	9,6689 ⁴	10,2500 ⁴
Clase ZU	12,6695	14,0938	15,8950

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

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		44.361.768
Ingresos		
Dividendos, neto	2	314.984
Interés bancario	2	13.932
Otros ingresos		15.244
Total de ingresos		344.160
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(6.974)
Interés bancario	2	(1.519)
Gastos operativos	3, 5	(17.663)
Total de gastos		(26.156)
Ingresos netos de inversiones		318.004
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(209.481)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(2.954)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(91.810)
(Pérdida) neta realizada		(304.245)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(1.635.649)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(4.850)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(1.640.499)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(1.626.740)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		15.143
Reembolsos de acciones		(33.550.495)
Dividendos	7	(13)
Total de movimientos de capital		(33.535.365)
Patrimonio neto al final del periodo		9.199.663

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
USD	9.199.663	44.361.768	95.614.006

Threadneedle (Lux) - Asia Equities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	100.992.103
Efectivo en el banco	2	610.355
Suscripciones por cobrar		75.831
Interés y dividendos por cobrar, neto		135.574
Otros activos	20	197
Total de activos		101.814.060
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(260.224)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(16)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(104.516)
Impuesto por pagar	3	(192.412)
Otros pasivos		(14.666)
Total de pasivos		(571.834)
Total de patrimonio neto		101.242.226

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	83,000
Clase AEH	83,000
Clase DE	83,000
Clase DEH	83,000
Clase IE	556.162,712
Clase IU	177.384,322
Clase ZU	19.857,424
Clase 1E	1.076.746,542
Clase 1U	21.711.414,315
Clase 2E	55,000
Clase 2U	1.613.965,683
Clase 3U	2.757.331,970
Clase 8E	665,418
Clase 8U	1.726.048,931
Clase 9U	131.351,402

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase AE	7,2258 ¹	7,7940 ¹	8,9696 ¹
Clase AEH	5,9419 ¹	6,6394 ¹	8,0913 ¹
Clase DE	7,1463 ¹	7,7281 ¹	8,9361 ¹
Clase DEH	5,8741 ¹	6,5830 ¹	8,0618 ¹
Clase IE	10,4770 ¹	11,2413 ¹	12,8045 ¹
Clase IU	10,4251	11,4782	13,3897
Clase ZU	10,3817	11,4362	13,3540
Clase 1E	2,5923 ¹	2,7919 ¹	3,2041 ¹
Clase 1U	2,7444	3,0330	3,5648
Clase 2E	11,1665 ¹	11,9878 ¹	13,6717 ¹
Clase 2U	10,3657	11,4208	13,3414
Clase 3U	2,5030	2,7558	3,2148
Clase 8E	2,9901 ¹	3,2110 ¹	3,6646 ¹
Clase 8U	3,1673	3,4904	4,0790
Clase 9U	10,4533	11,5069	13,4178

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

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		117.103.250
Ingresos		
Dividendos, neto	2	1.749.850
Interés bancario	2	26.685
Otros ingresos		1.492
Total de ingresos		1.778.027
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(692.861)
Interés bancario	2	(24)
Impuestos extranjeros	3	(192.061)
Gastos operativos	3, 5	(97.556)
Comisiones varias	4	(2.199)
Total de gastos		(984.701)
Ingresos netos de inversiones		793.326
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(6.887.226)
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		322
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(35.161)
(Pérdida) neta realizada		(6.922.065)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(4.524.125)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(29)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(4.524.154)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(10.652.893)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		2.387.388
Reembolsos de acciones		(7.595.519)
Total de movimientos de capital		(5.208.131)
Patrimonio neto al final del periodo		101.242.226

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
USD	101.242.226	117.103.250	142.380.978

Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	311.652.066
Efectivo en el banco	2	13.985.018
Por cobrar para la venta de inversiones		700.250
Suscripciones por cobrar		6.316
Interés y dividendos por cobrar, neto		143.295
Otros activos		60
Total de activos		326.487.005
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(530.326)
Reembolsos pagaderos		(37.906)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(427.982)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(153.097)
Otros pasivos		(65.525)
Total de pasivos		(1.214.836)
Total de patrimonio neto		325.272.169

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	52,844
Clase AEH	23.715,342
Clase AU	79.946,464
Clase AUP	7.022,401
Clase DU	6.126,727
Clase IU	1.902.964,686
Clase XS	69,000
Clase XSH	6.235.037,823
Clase ZEH	293.991,037
Clase ZFH	48,000
Clase ZGH	35,000
Clase ZU	3.055.212,429

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase AEC	16,8948 ¹	16,0772 ¹	18,8839 ¹
Clase AEH	28,5928 ¹	27,0377 ¹	31,2589 ¹
Clase AU	55,3536	51,7687	57,7098
Clase AUP	19,6133	18,4680	20,8998
Clase DU	27,2834	25,5801	28,6587
Clase IU	81,1446	75,5875	83,5904
Clase XS	20,2783 ²	18,3141 ²	20,4221 ²
Clase XSH	19,8872 ²	18,5872 ²	20,6253 ²
Clase ZEH	18,8957 ¹	17,8024 ¹	20,4263 ¹
Clase ZFH	18,2009 ³	17,3160 ³	19,9729 ³
Clase ZGH	20,0713 ⁴	18,7761 ⁴	21,2839 ⁴
Clase ZU	22,4783	20,9441	23,1731

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

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		267.820.562
Ingresos		
Dividendos, neto	2	1.315.318
Interés bancario	2	211.463
Total de ingresos		1.526.781
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(871.896)
Interés bancario	2	(1.543)
Gastos operativos	3, 5	(379.791)
Total de gastos		(1.253.230)
Ingresos netos de inversiones		273.551
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		5.871.866
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(1.703.715)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		61.401
Ganancia neta realizada		4.229.552
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		12.428.296
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(1.398.533)
Cambio neto en ganancia no realizada		11.029.763
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		15.532.866
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		73.072.694
Reembolsos de acciones		(31.153.001)
Dividendos	7	(952)
Total de movimientos de capital		41.918.741
Patrimonio neto al final del periodo		325.272.169

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
USD	325.272.169	267.820.562	379.069.017

Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	157.048.356
Efectivo en el banco	2	1.816.640
Por cobrar para la venta de inversiones		4.788.061
Suscripciones por cobrar		311.094
Interés y dividendos por cobrar, neto		109.750
Total de activos		164.073.901
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(4.808.789)
Reembolsos pagaderos		(87.086)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(745)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(13.195)
Otros pasivos		(14.205)
Total de pasivos		(4.924.020)
Total de patrimonio neto		159.149.881

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	368,991
Clase AEH	54,100
Clase AU	59,094
Clase AUP	63,640
Clase DE	13.949,034
Clase DEH	2.610,637
Clase DU	942,044
Clase IE	52,100
Clase IEC	58,100
Clase IEH	54,100
Clase IFH	59,100
Clase IG	15.647,567
Clase IU	57,576
Clase NE	51.008,895
Clase NG	7.507.091,099
Clase NU	1.779.558,223
Clase XG	59,000
Clase ZEH	54,100
Clase ZFH	60,100
Clase ZU	755,717

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		127.108.114
Ingresos		
Dividendos, neto	2	854.197
Interés bancario	2	1.547
Total de ingresos		855.744
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(76.573)
Gastos operativos	3, 5	(74.207)
Total de gastos		(150.780)
Ingresos netos de inversiones		704.964
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		1.132.221
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		7.644
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		1.958
Ganancia neta realizada		1.141.823
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		3.934.804
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(6.161)
Cambio neto en ganancia no realizada		3.928.643
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		5.775.430
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		36.828.712
Reembolsos de acciones		(10.562.360)
Dividendos	7	(15)
Total de movimientos de capital		26.266.337
Patrimonio neto al final del periodo		159.149.881

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
USD	159.149.881	127.108.114	78.667.240

Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase AE	18,5725 ¹	17,3387 ¹	18,2898 ¹
Clase AEH	15,2024 ¹	14,7127 ¹	16,4623 ¹
Clase AU	17,6559	16,9147	18,2540
Clase AUP	15,6359	15,0962	16,5908
Clase DE	18,3319 ¹	17,1314 ¹	18,1073 ¹
Clase DEH	15,0014 ¹	14,5482 ¹	16,3108 ¹
Clase DU	17,4168	16,7021	18,0794
Clase IE	18,9399 ¹	17,6533 ¹	18,5659 ¹
Clase IEC	13,6720 ¹	13,3367 ¹	15,1809 ¹
Clase IEH	15,4802 ¹	14,9688 ¹	16,7198 ¹
Clase IFH	15,1219 ²	14,7703 ²	16,5489 ²
Clase IG	15,5114 ³	14,6434 ³	14,8037 ³
Clase IU	18,0240	17,2386	18,5671
Clase NE	15,3107 ¹	14,2582 ¹	14,9581 ¹
Clase NG	14,5441 ³	13,7199 ³	13,8493 ³
Clase NU	13,7126	13,1041	14,0857
Clase XG	14,6372 ³	13,7984 ³	13,9108 ³
Clase ZEH	15,4147 ¹	14,9070 ¹	16,6597 ¹
Clase ZFH	15,0306 ²	14,6835 ²	16,4549 ²
Clase ZU	17,9162	17,1426	18,4729

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

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

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

Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	484.064.325
Efectivo en el banco	2	1.468.242
Suscripciones por cobrar		112.734
Interés y dividendos por cobrar, neto		248.602
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	92.860
Otros activos	20	768.100
Total de activos		486.754.863
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(273.664)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(260.110)
Otros pasivos		(44.583)
Total de pasivos		(578.357)
Total de patrimonio neto		486.176.506

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	152.571,456
Clase ASH	464.790,626
Clase AUH	4.627,340
Clase DE	132.501,498
Clase IE	3.023.827,684
Clase W	30.997,242
Clase XE	1.551.405,825
Clase ZE	719.298,557
Clase ZUH	5.381,483
Clase 1E	2.821.794,441
Clase 1EP	65,000
Clase 1G	157.308,122
Clase 1GP	59,000
Clase 2E	7.246.787,227
Clase 2G	431.080,148
Clase 2U	73,000
Clase 3E	112.311,279
Clase 3G	213.024,337
Clase 3GP	391,931
Clase 4E	821.960,146
Clase 4G	55,000
Clase 8E	211.988,594
Clase 8G	26.252,855
Clase 8U	73,000
Clase 9E	62,000
Clase 9G	56,000
Clase 9GP	57,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		435.474.263
Ingresos		
Dividendos, neto	2	8.199.522
Interés bancario	2	4.738
Otros ingresos		490
Total de ingresos		8.204.750
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.621.759)
Interés bancario	2	(147)
Gastos operativos	3, 5	(273.841)
Total de gastos		(1.895.747)
Ingresos netos de inversiones		6.309.003
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(3.575.441)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(193.035)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		12.829
(Pérdida) neta realizada		(3.755.647)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(6.575.145)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		67.912
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(6.507.233)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(3.953.877)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		93.021.497
Reembolsos de acciones		(38.365.377)
Total de movimientos de capital		54.656.120
Patrimonio neto al final del periodo		486.176.506

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
EUR	486.176.506	435.474.263	475.145.184

Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase AE	82,7832	83,5774	83,5781
Clase ASH	24,4176 ¹	24,5969 ¹	24,0735 ¹
Clase AUH	29,9026 ²	29,8927 ²	28,9294 ²
Clase DE	29,7406	30,0559	30,1163
Clase IE	59,4342	59,7803	59,3341
Clase W	69,2409	69,9400	70,0340
Clase XE	70,1041	70,2841	69,2730
Clase ZE	9,8187	9,8833	9,8259
Clase ZUH	19,7432 ²	19,6715 ²	18,9486 ²
Clase 1E	13,1767	13,3051	13,3070
Clase 1EP	12,1808	12,3086	12,6891
Clase 1G	12,7031 ³	12,9932 ³	12,4978 ³
Clase 1GP	11,7498 ³	12,0282 ³	11,9244 ³
Clase 2E	13,5401	13,6414	13,5821
Clase 2G	13,0525 ³	13,3206 ³	12,7552 ³
Clase 2U	12,3040 ²	12,7149 ²	12,9544 ²
Clase 3E	13,6353	13,7277	13,6488
Clase 3G	13,1446 ³	13,4053 ³	12,8183 ³
Clase 3GP	12,1806 ³	12,4223 ³	12,2439 ³
Clase 4E	14,2457	14,2809	14,0773
Clase 4G	13,7580 ³	13,9701 ³	13,2403 ³
Clase 8E	13,5070	13,6107	13,5570
Clase 8G	13,0266 ³	13,2969 ³	12,7375 ³
Clase 8U	12,2756 ²	12,6872 ²	12,9310 ²
Clase 9E	13,7052	13,7945	13,7069
Clase 9G	13,2049 ³	13,4619 ³	12,8673 ³
Clase 9GP	12,2500 ³	12,4892 ³	12,3004 ³

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

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

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

Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	52.873.336
Efectivo en el banco	2	410.224
Por cobrar para la venta de inversiones		351.393
Suscripciones por cobrar		15.581
Interés y dividendos por cobrar, neto		35.843
Otros activos	20	287.644
Total de activos		53.974.021
Pasivos		
Descubiertos bancarios		(7.360)
Reembolsos pagaderos		(23.626)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(38.171)
Otros pasivos		(6.459)
Total de pasivos		(75.616)
Total de patrimonio neto		53.898.405

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	10.603,611
Clase AEP	42.627,132
Clase AUP	80,000
Clase DE	1.455,750
Clase DEP	17.583,069
Clase IE	263.011,109
Clase IEP	648.196,000
Clase ZE	65,000
Clase ZEP	26.246,354
Clase 1E	3.400.286,625
Clase 1EP	9.990.522,139
Clase 1G	145.942,732
Clase 1GP	333.061,646
Clase 2E	798.059,278
Clase 2EP	72,000
Clase 2G	58,000
Clase 2GP	63,000
Clase 3EP	86.944,921
Clase 3G	74.589,677
Clase 3GP	544.011,998
Clase 4GP	7.350.534,040
Clase 8E	246.276,001
Clase 8EP	848.007,733
Clase 8G	16.041,603
Clase 8GP	490.823,668
Clase 9EP	3.371,000
Clase 9G	57,000
Clase 9GP	263,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		69.486.743
Ingresos		
Dividendos, neto	2	1.689.698
Interés bancario	2	1.714
Otros ingresos		59
Total de ingresos		1.691.471
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(260.880)
Gastos operativos	3, 5	(45.505)
Total de gastos		(306.385)
Ingresos netos de inversiones		1.385.086
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		2.591.406
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(135)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(3.593)
Ganancia neta realizada		2.587.678
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(3.962.044)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(3.962.044)
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		10.720
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		1.115.006
Reembolsos de acciones		(15.806.594)
Dividendos	7	(907.470)
Total de movimientos de capital		(15.599.058)
Patrimonio neto al final del periodo		53.898.405

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
EUR	53.898.405	69.486.743	60.925.035

Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase AE	12,5421	12,6500	12,2899
Clase AEP	10,2073	10,5858	10,7997
Clase AUP	9,8027 ¹	10,4337 ¹	10,9127 ¹
Clase DE	12,3191	12,4468	12,1356
Clase DEP	10,0214	10,4095	10,6571
Clase IE	13,1549	13,1920	12,6707
Clase IEP	10,7074	11,0419	11,1344
Clase ZE	13,0015	13,0688	12,6183
Clase ZEP	10,5892	10,9401	11,0767
Clase 1E	2,0504	2,0670	2,0062
Clase 1EP	1,0129	1,0503	1,0714
Clase 1G	1,7784 ²	1,8160 ²	1,6952 ²
Clase 1GP	0,8799 ²	0,9240 ²	0,9066 ²
Clase 2E	12,9949	13,0603	12,5994
Clase 2EP	10,6065	10,9561	11,0904
Clase 2G	12,8556 ²	13,0785 ²	12,1240 ²
Clase 2GP	10,4519 ²	10,9385 ²	10,6484 ²
Clase 3EP	1,6767	1,7311	1,7509
Clase 3G	1,7457 ²	1,7759 ²	1,6454 ²
Clase 3GP	1,4446 ²	1,5112 ²	1,4708 ²
Clase 4GP	1,3002 ²	1,3545 ²	1,3081 ²
Clase 8E	2,2865	2,2984	2,2182
Clase 8EP	1,1165	1,1545	1,1693
Clase 8G	1,9849 ²	2,0212 ²	1,8760 ²
Clase 8GP	0,9691 ²	1,0142 ²	0,9875 ²
Clase 9EP	10,6862	11,0341	11,1480
Clase 9G	12,9288 ²	13,1481 ²	12,1739 ²
Clase 9GP	10,5286 ²	11,0089 ²	10,6983 ²

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

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

Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	340.560.209
Efectivo en el banco	2	2.309.603
Por cobrar para la venta de inversiones		970.408
Suscripciones por cobrar		67.667
Interés y dividendos por cobrar, neto		314.118
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	79.229
Otros activos	20	794.199
Total de activos		345.095.433
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(2.264.435)
Reembolsos pagaderos		(961.783)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(385.376)
Otros pasivos		(91.163)
Total de pasivos		(3.702.757)
Total de patrimonio neto		341.392.676

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	4.438.244,068
Clase ASH	354.709,826
Clase AUH	612,001
Clase DE	1.095.157,160
Clase DUH	275,000
Clase IE	1.570.779,286
Clase W	9.912,171
Clase XE	88,000
Clase ZE	2.896.275,775
Clase ZFH	5.601,004

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase AE	40,8776	43,8005	50,4135
Clase ASH	28,8034 ¹	30,8067 ¹	34,6658 ¹
Clase AUH	11,3758 ²	12,0652 ²	13,4075 ²
Clase DE	36,0379	38,7886	45,0490
Clase DUH	10,8439 ²	11,5560 ²	12,9610 ²
Clase IE	52,3328	55,8653	63,8189
Clase W	68,2931	73,1946	84,2877
Clase XE	8,6664	9,2026	10,4050
Clase ZE	10,5248	11,2353	12,8349
Clase ZFH	9,9563 ³	10,7434 ³	12,3467 ³

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

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		391.734.563
Ingresos		
Dividendos, neto	2	4.659.362
Interés bancario	2	5.171
Otros ingresos		379
Total de ingresos		4.664.912
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(2.577.545)
Interés bancario	2	(30)
Gastos operativos	3, 5	(610.089)
Total de gastos		(3.187.664)
Ingresos netos de inversiones		1.477.248
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(6.045.411)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(66.769)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(16.552)
(Pérdida) neta realizada		(6.128.732)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(19.707.965)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		66.074
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(19.641.891)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(24.293.375)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		13.959.335
Reembolsos de acciones		(40.007.847)
Total de movimientos de capital		(26.048.512)
Patrimonio neto al final del periodo		341.392.676

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
EUR	341.392.676	391.734.563	673.597.948

Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	626.906.698
Efectivo en el banco	2	3.816.434
Por cobrar para la venta de inversiones		5.435.740
Suscripciones por cobrar		71.567
Interés y dividendos por cobrar, neto		583.470
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	236.903
Otros activos	20	2.035.338
Total de activos		639.086.150
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(4.195.015)
Reembolsos pagaderos		(697.529)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(522.222)
Otros pasivos		(89.008)
Total de pasivos		(5.503.774)
Total de patrimonio neto		633.582.376

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase IE	905.066,628
Clase ZE	806.625,277
Clase 1E	18.032.633,071
Clase 1EP	639.980,960
Clase 1FH	190.279,256
Clase 1G	512.968,702
Clase 1UH	1.384.617,187
Clase 2E	14.834.055,023
Clase 2G	56,000
Clase 3E	10.172.894,425
Clase 3EP	811.549,739
Clase 3FH	576.921,126
Clase 3G	1.734.354,280
Clase 3GP	99.973,061
Clase 3UH	685.440,399
Clase 4E	1.784.681,748
Clase 4G	1.832.020,560
Clase 8E	3.090.616,242
Clase 8G	452.870,926
Clase 9E	5.576.793,681
Clase 9EP	124,000
Clase 9FH	28.204,059
Clase 9G	10.980,318
Clase 9GP	57,000
Clase 9UH	66.730,006

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		746.467.483
Ingresos		
Dividendos, neto	2	9.894.972
Interés bancario	2	4.068
Otros ingresos		566
Total de ingresos		9.899.606
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(3.535.733)
Interés bancario	2	(2.309)
Gastos operativos	3, 5	(524.662)
Total de gastos		(4.062.704)
Ingresos netos de inversiones		5.836.902
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(19.108.906)
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		305.067
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(50.288)
(Pérdida) neta realizada		(18.854.127)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(35.785.502)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		632.955
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(35.152.547)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(48.169.772)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		15.302.456
Reembolsos de acciones		(80.017.791)
Total de movimientos de capital		(64.715.335)
Patrimonio neto al final del periodo		633.582.376

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
EUR	633.582.376	746.467.483	1.236.395.974

Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase IE	10,0881	10,8544	12,1084
Clase ZE	9,7706	10,5207	11,7537
Clase 1E	9,4700	10,2286	11,4986
Clase 1EP	8,8284	9,5356	10,9343
Clase 1FH	9,2272 ¹	10,0750 ¹	11,3955 ¹
Clase 1G	9,1274 ²	9,9865 ²	10,7968 ²
Clase 1UH	10,5775 ³	11,3113 ³	12,2785 ³
Clase 2E	9,7862	10,5360	11,7673
Clase 2G	9,4427 ²	10,2944 ²	11,0646 ²
Clase 3E	9,8676	10,6150	11,8366
Clase 3EP	9,2032	9,9003	11,2596
Clase 3FH	9,6146 ¹	10,4566 ¹	11,7317 ¹
Clase 3G	9,5096 ²	10,3626 ²	11,1130 ²
Clase 3GP	8,8699 ²	9,6655 ²	10,5711 ²
Clase 3UH	11,0168 ³	11,7341 ³	12,6338 ³
Clase 4E	10,2982	11,0319	12,1985
Clase 4G	11,1079 ²	12,0536 ²	12,8182 ²
Clase 8E	9,7683	10,5187	11,7527
Clase 8G	9,4149 ²	10,2696 ²	11,0354 ²
Clase 9E	9,8889	10,6358	11,8550
Clase 9EP	9,2441	9,9388	11,2856
Clase 9FH	9,6364 ¹	10,4765 ¹	11,7487 ¹
Clase 9G	9,5328 ²	10,3853 ²	11,1328 ²
Clase 9GP	8,9195 ²	9,7133 ²	10,6036 ²
Clase 9UH	11,0468 ³	11,7629 ³	12,6594 ³

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

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

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

Threadneedle (Lux) - European Select

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	1.480.752.657
Efectivo en el banco	2	2.364.843
Por cobrar para la venta de inversiones		6.927.072
Suscripciones por cobrar		865.818
Interés y dividendos por cobrar, neto		78
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	424.653
Otros activos	20	4.847.258
Total de activos		1.496.182.379
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(1.713.394)
Reembolsos pagaderos		(502.635)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(1.595.059)
Otros pasivos		(165.419)
Total de pasivos		(3.976.507)
Total de patrimonio neto		1.492.205.872

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	141.236,275
Clase AGH	19.986,964
Clase AUH	14.898,899
Clase DUH	66,000
Clase IE	454.312,130
Clase ZE	85,000
Clase ZG	17.420,929
Clase ZGH	159.627,771
Clase 1E	72.256.336,918
Clase 1EP	921.229,035
Clase 1SH	1.582.249,868
Clase 1U	35.887,060
Clase 1UH	1.280.813,157
Clase 2E	4.991.309,857
Clase 2EP	57,000
Clase 3E	1.775.310,731
Clase 3U	541.929,379
Clase 8E	1.942.973,958
Clase 8EP	8.250,536
Clase 9E	16.380.561,072
Clase 9U	63,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		1.532.090.351
Ingresos		
Dividendos, neto	2	21.245.420
Interés bancario	2	6.126
Otros ingresos		192
Total de ingresos		21.251.738
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(10.317.713)
Interés bancario	2	(4.298)
Gastos operativos	3, 5	(1.073.053)
Total de gastos		(11.395.064)
Ingresos netos de inversiones		9.856.674
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		22.830.951
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		245.276
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		67.877
Ganancia neta realizada		23.144.104
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(75.605.489)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		610.032
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(74.995.457)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(41.994.679)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		116.621.394
Reembolsos de acciones		(114.511.194)
Total de movimientos de capital		2.110.200
Patrimonio neto al final del periodo		1.492.205.872

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

30 de septiembre de 2023 31 de marzo de 2023 31 de marzo de 2022

EUR 1.492.205.872 1.532.090.351 1.623.386.971

Threadneedle (Lux) - European Select

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase AE	29,8766	30,7946	30,1120
Clase AGH	32,6474 ¹	33,4259 ¹	32,2683 ¹
Clase AUH	35,4042 ²	36,1250 ²	34,1941 ²
Clase DUH	14,6614 ²	15,0044 ²	14,2740 ²
Clase IE	43,9738	45,1332	43,7595
Clase ZE	9,1306	9,3846	9,1184
Clase ZG	15,0290 ¹	15,6331 ¹	14,5919 ¹
Clase ZGH	34,0967 ¹	34,7713 ¹	33,3203 ¹
Clase 1E	14,2900	14,7181	14,3703
Clase 1EP	13,3522	13,7522	13,6418
Clase 1SH	15,2341 ³	15,6546 ³	14,9506 ³
Clase 1U	13,0652 ²	13,8087 ²	13,8075 ²
Clase 1UH	15,8713 ²	16,1804 ²	15,2829 ²
Clase 2E	14,7127	15,1090	14,6652
Clase 2EP	13,7686	14,1356	13,9345
Clase 3E	14,8449	15,2310	14,7570
Clase 3U	13,5706 ²	14,2879 ²	14,1771 ²
Clase 8E	14,6843	15,0828	14,6457
Clase 8EP	13,7335	14,1062	13,9187
Clase 9E	14,8733	15,2571	14,7765
Clase 9U	13,6138 ²	14,3329 ²	14,2172 ²

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

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

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

Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	1.340.185.338
Efectivo en el banco	2	1.246.579
Suscripciones por cobrar		491.423
Interés y dividendos por cobrar, neto		1.082.174
Otros activos	20	3.941.924
Total de activos		1.346.947.438
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(8.853.786)
Reembolsos pagaderos		(1.543.860)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(109.797)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(1.506.174)
Otros pasivos		(226.583)
Total de pasivos		(12.240.200)
Total de patrimonio neto		1.334.707.238

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase IE	805.569,110
Clase ZE	739.083,560
Clase 1E	87.409.796,829
Clase 1EP	3.512.241,439
Clase 1FH	61,000
Clase 2E	1.759.988,723
Clase 3E	4.754.756,403
Clase 3EP	70.835,865
Clase 3FH	790.675,982
Clase 8E	4.221.614,143
Clase 9E	5.049.331,056
Clase 9EP	554.845,000
Clase 9FH	221,000

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase IE	11,2738	12,0030	12,6494
Clase ZE	12,5088	13,3280	14,0668
Clase 1E	12,1331	12,9677	13,7718
Clase 1EP	11,3498	12,1305	13,1298
Clase 1FH	11,8404 ¹	12,7811 ¹	13,6535 ¹
Clase 2E	12,5306	13,3491	14,0850
Clase 3E	12,5872	13,4001	14,1189
Clase 3EP	11,7967	12,5586	13,4851
Clase 3FH	12,2885 ¹	13,2238 ¹	14,0261 ¹
Clase 8E	12,5082	13,3279	14,0682
Clase 9E	12,6397	13,4533	14,1693
Clase 9EP	11,8301	12,5916	13,5144
Clase 9FH	12,2977 ¹	13,2294 ¹	14,0265 ¹

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

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		1.444.642.805
Ingresos		
Dividendos, neto	2	19.095.515
Interés bancario	2	471
Otros ingresos		2.127
Total de ingresos		19.098.113
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(9.827.074)
Interés bancario	2	(76)
Gastos operativos	3, 5	(1.475.879)
Total de gastos		(11.303.029)
Ingresos netos de inversiones		7.795.084
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		15.012.911
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		111.692
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(35.389)
Ganancia neta realizada		15.089.214
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(114.016.396)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		37.325
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(113.979.071)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(91.094.773)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		47.168.493
Reembolsos de acciones		(66.009.287)
Total de movimientos de capital		(18.840.794)
Patrimonio neto al final del periodo		1.334.707.238

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
EUR	1.334.707.238	1.444.642.805	1.772.635.200

Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	73.114.451
Efectivo en el banco	2	1.206.433
Por cobrar para la venta de inversiones		228.094
Suscripciones por cobrar		1.306
Interés y dividendos por cobrar, neto		126.697
Otros activos	20	174
Total de activos		74.677.155
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(119.351)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(87.057)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(30.314)
Impuesto por pagar	3	(47.950)
Otros pasivos		(11.549)
Total de pasivos		(296.221)
Total de patrimonio neto		74.380.934

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	29.863,660
Clase ASC	135,000
Clase AU	46.082,463
Clase AUP	115.297,223
Clase DEH	162.313,349
Clase DU	41.686,234
Clase DUP	27.994,174
Clase IEP	1.075.402,266
Clase IU	70,000
Clase W	19.129,778
Clase XU	1.307.720,471
Clase XUP	2.643.045,022
Clase ZG	51,000
Clase ZGH	6.917,198
Clase ZGP	56,000
Clase ZU	100,000
Clase ZUP	3.930,526

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase AEH	36,0039 ¹	38,9105 ¹	45,2875 ¹
Clase ASC ²	9,3438 ²	—	—
Clase AU	95,3692	101,8799	114,4216
Clase AUP	10,4961	11,5123	13,4844
Clase DEH	25,1397 ¹	27,2703 ¹	31,9765 ¹
Clase DU	45,5659	48,8592	55,2874
Clase DUP	10,1068	11,1252	13,1305
Clase IEP	11,6056 ¹	12,3493 ¹	14,0025 ¹
Clase IU	11,1691	11,8781	13,2161
Clase W	70,2727	75,1452	84,5649
Clase XU	12,6288	13,3803	14,7814
Clase XUP	11,2863	12,2763	14,1419
Clase ZG	12,6059 ³	13,2498 ³	13,8913 ³
Clase ZGH	21,2012 ³	22,6597 ³	25,8292 ³
Clase ZGP	10,3594 ³	11,1818 ³	12,2208 ³
Clase ZU	8,3121	8,8505	9,8775
Clase ZUP	12,3574	13,5022	15,6966

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

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		52.248.309
Ingresos		
Dividendos, neto	2	1.578.262
Interés bancario	2	30.780
Otros ingresos		219
Total de ingresos		1.609.261
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(200.855)
Interés bancario	2	(3.686)
Impuestos extranjeros	3	(47.863)
Gastos operativos	3, 5	(66.894)
Comisiones varias	4	(14.978)
Total de gastos		(334.276)
Ingresos netos de inversiones		1.274.985
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(2.441.348)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(56.043)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		37.693
(Pérdida) neta realizada		(2.459.698)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(4.196.904)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(155.828)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(4.352.732)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(5.537.445)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		32.059.493
Reembolsos de acciones		(3.200.783)
Dividendos	7	(1.188.640)
Total de movimientos de capital		27.670.070
Patrimonio neto al final del periodo		74.380.934

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
USD	74.380.934	52.248.309	52.164.940

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Technology

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	707.541.668
Efectivo en el banco	2	23.976.902
Por cobrar para la venta de inversiones		357.796
Suscripciones por cobrar		1.326.756
Interés y dividendos por cobrar, neto		223.783
Total de activos		733.426.905
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(147.932)
Reembolsos pagaderos		(719.672)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(1.223.962)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(819.500)
Otros pasivos		(162.035)
Total de pasivos		(3.073.101)
Total de patrimonio neto		730.353.804

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	660.504,344
Clase AS	866.353,194
Clase AU	3.161.013,963
Clase AUP	78.085,071
Clase BU	53.776,987
Clase DEH	274.113,206
Clase DU	559.431,849
Clase IE	793.290,065
Clase IEH	1.077.623,976
Clase IG	20.769,873
Clase IU	10.481.085,967
Clase ZEH	111.702,832
Clase ZFH	23.487,571
Clase ZG	81.197,759
Clase ZU	1.330.196,377

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase AEH	66,7714 ¹	62,5310 ¹	73,7380 ¹
Clase AS	24,6963 ²	22,3014 ²	25,6949 ²
Clase AU	93,8528	87,0049	98,4809
Clase AUP	19,9119	18,4591	21,0644
Clase BU	117,7647	109,3899	124,3152
Clase DEH	19,0637 ¹	17,8847 ¹	21,1515 ¹
Clase DU	136,9121	127,1439	144,4193
Clase IE	17,6651 ¹	15,8873 ¹	17,4019 ¹
Clase IEH	23,0053 ¹	21,4521 ¹	25,0771 ¹
Clase IG	24,2453 ³	22,0881 ³	23,2680 ³
Clase IU	16,8480	15,5489	17,4419
Clase ZEH	19,0527 ¹	17,7747 ¹	20,7904 ¹
Clase ZFH	21,9694 ⁴	20,7055 ⁴	24,2713 ⁴
Clase ZG	24,1370 ³	22,0003 ³	23,1988 ³
Clase ZU	43,4577	40,1267	45,0572

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

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		643.257.608
Ingresos		
Dividendos, neto	2	1.924.598
Interés bancario	2	475.809
Total de ingresos		2.400.407
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(4.870.476)
Interés bancario	2	(4.794)
Gastos operativos	3, 5	(945.473)
Total de gastos		(5.820.743)
(Pérdida) neta de inversiones		(3.420.336)
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		16.265.658
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(850.310)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		2.592
Ganancia neta realizada		15.417.940
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		36.736.782
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(2.048.754)
Cambio neto en ganancia no realizada		34.688.028
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		46.685.632
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		131.206.250
Reembolsos de acciones		(90.795.686)
Total de movimientos de capital		40.410.564
Patrimonio neto al final del periodo		730.353.804

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
USD	730.353.804	643.257.608	651.663.253

Threadneedle (Lux) - UK Equities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 GBP
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	101.690.449
Efectivo en el banco	2	107.196
Interés y dividendos por cobrar, neto		358.198
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	77.825
Otros activos		82
Total de activos		102.233.750
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(82.690)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(71.628)
Otros pasivos		(19.632)
Total de pasivos		(173.950)
Total de patrimonio neto		102.059.800

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	50.861,772
Clase AEH	123.966,261
Clase AFH	7.192,000
Clase AG	362.195,240
Clase AGP	29.845,878
Clase DEH	3.029,846
Clase DG	7.715,553
Clase IE	414.102,908
Clase IEH	37.201,732
Clase IG	1.629.989,696
Clase IGP	210.535,854
Clase NEH	66,000
Clase NFH	73,000
Clase NG	57,000
Clase NGP	57,000
Clase NUH	78,000
Clase TEH	66,000
Clase TFH	73,000
Clase TG	57,000
Clase TGP	57,000
Clase TUH	78,000
Clase ZE	16.736,740
Clase ZEH	67.842,212
Clase ZFH	3.325,000
Clase ZG	112.240,151
Clase ZGP	82.489,118
Clase ZUH	89,000
Clase 3EH	639.942,488
Clase 3FH	471,000
Clase 3UH	777.318,066
Clase 9EH	14.983,465
Clase 9EP	81,000
Clase 9FH	85,000
Clase 9G	410,000
Clase 9UH	87,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 GBP
Patrimonio neto al inicio del periodo		167.301.421
Ingresos		
Dividendos, neto	2	3.068.177
Interés bancario	2	16.561
Total de ingresos		3.084.738
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(567.663)
Interés bancario	2	(594)
Gastos operativos	3, 5	(147.579)
Total de gastos		(715.836)
Ingresos netos de inversiones		2.368.902
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(283.626)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(418.861)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(299)
(Pérdida) neta realizada		(702.786)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(3.714.545)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		195.711
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(3.518.834)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(1.852.718)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		11.514.688
Reembolsos de acciones		(74.739.632)
Dividendos	7	(163.959)
Total de movimientos de capital		(63.388.903)
Patrimonio neto al final del periodo		102.059.800

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
GBP	102.059.800	167.301.421	274.453.238

Threadneedle (Lux) - UK Equities

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase AE	9,3968 ¹	9,4273 ¹	9,3165 ¹
Clase AEH	20,1100 ¹	20,6050 ¹	19,9122 ¹
Clase AFH	9,6473 ²	9,9885 ²	9,7085 ²
Clase AG	28,8364	29,3049	27,8526
Clase AGP	19,9626	20,7157	20,3018
Clase DEH	9,3656 ¹	9,6352 ¹	9,3874 ¹
Clase DG	9,9512	10,1533	9,7276
Clase IE	10,2018 ¹	10,1864 ¹	9,9716 ¹
Clase IEH	30,8590 ¹	31,4994 ¹	30,1611 ¹
Clase IG	42,7622	43,2514	40,7193
Clase IGP	29,9201	30,8986	29,9926
Clase NEH	12,7298 ¹	12,9677 ¹	12,3773 ¹
Clase NFH	12,5331 ²	12,8955 ²	12,3772 ²
Clase NG	13,1725	13,3079	12,5034
Clase NGP	12,0456	12,4219	12,0225
Clase NUH	13,5126 ³	13,6193 ³	12,6056 ³
Clase TEH	12,7172 ¹	12,9563 ¹	12,3724 ¹
Clase TFH	12,5217 ²	12,8835 ²	12,3703 ²
Clase TG	13,1740	13,3116	12,5042
Clase TGP	12,0281	12,4067	12,0170
Clase TUH	13,5071 ³	13,6152 ³	12,6005 ³
Clase ZE	9,6515 ¹	9,6466 ¹	9,4643 ¹
Clase ZEH	12,6035 ¹	12,8699 ¹	12,3480 ¹
Clase ZFH	12,0280 ²	12,4052 ²	11,9648 ²
Clase ZG	28,2642	28,6161	26,9947
Clase ZGP	10,7183	11,0805	10,7776
Clase ZUH	11,6693 ³	11,8096 ³	10,9752 ³
Clase 3EH	1,8020 ¹	1,8386 ¹	1,7608 ¹
Clase 3FH	1,9062 ²	1,9650 ²	1,8918 ²
Clase 3UH	2,3339 ³	2,3556 ³	2,1863 ³
Clase 9EH	10,8148 ¹	11,0302 ¹	10,5479 ¹
Clase 9EP	9,6807 ¹	9,8665 ¹	9,9562 ¹
Clase 9FH	10,6164 ²	10,9400 ²	10,5292 ²
Clase 9G	10,6139	10,7349	10,1044
Clase 9UH	11,9998 ³	12,1115 ³	11,2422 ³

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

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

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

Threadneedle (Lux) - UK Equity Income

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 GBP
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	227.613.543
Efectivo en el banco	2	245.737
Por cobrar para la venta de inversiones		554.489
Suscripciones por cobrar		129.943
Interés y dividendos por cobrar, neto		741.228
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	140.317
Total de activos		229.425.257
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(2.110.492)
Reembolsos pagaderos		(129.074)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(117.652)
Otros pasivos		(36.299)
Total de pasivos		(2.393.517)
Total de patrimonio neto		227.031.740

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	1.230.243,260
Clase AEC	45.749,626
Clase AEH	111.449,506
Clase AG	452.124,059
Clase ASC	518,179
Clase AUC	78.362,574
Clase DE	2.654,203
Clase DEC	12.739,967
Clase DEH	4.312,053
Clase DG	24.446,397
Clase DGP	478,528
Clase IE	2.085.114,446
Clase IEH	18.282,848
Clase IG	177.793,322
Clase IGP	1.364.829,031
Clase IU	641.565,687
Clase IUH	80,000
Clase LG	604.621,123
Clase LGP	11.453.726,453
Clase ZE	55.053,983
Clase ZEH	59.806,987
Clase ZFH	10.046,000
Clase ZG	149.426,558
Clase ZGP	88.598,395
Clase ZUH	62.480,240
Clase 1EH	122.688,297
Clase 1FH	5.918,663
Clase 1UH	60.234,970
Clase 3EH	113.660,353
Clase 3FH	48.973,018
Clase 3UH	199.208,503
Clase 9EH	73,000
Clase 9FH	81,000
Clase 9G	963.776,887
Clase 9UH	2.174,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 GBP
Patrimonio neto al inicio del periodo		240.799.193
Ingresos		
Dividendos, neto	2	4.899.014
Interés bancario	2	11.284
Total de ingresos		4.910.298
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(777.986)
Interés bancario	2	(1.077)
Gastos operativos	3, 5	(237.172)
Total de gastos		(1.016.235)
Ingresos netos de inversiones		3.894.063
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		8.024.145
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(332.824)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(89.656)
Ganancia neta realizada		7.601.665
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(6.780.744)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		268.267
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(6.512.477)
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		4.983.251
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		38.044.876
Reembolsos de acciones		(53.696.234)
Dividendos	7	(3.099.346)
Total de movimientos de capital		(18.750.704)
Patrimonio neto al final del periodo		227.031.740

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
GBP	227.031.740	240.799.193	232.631.300

Threadneedle (Lux) - UK Equity Income

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase AE	12,9886 ¹	12,6013 ¹	12,6812 ¹
Clase AEC	9,3456 ¹	9,4634 ¹	9,6686 ¹
Clase AEH	11,8839 ¹	11,7767 ¹	11,5877 ¹
Clase AG	12,8110	12,5901	12,1852
Clase ASC	10,0040 ²	10,1010 ²	10,1013 ²
Clase AUC	10,6871 ³	10,7034 ³	10,6068 ³
Clase DE	12,3283 ¹	12,0054 ¹	12,1725 ¹
Clase DEC	8,8242 ¹	8,9702 ¹	9,2267 ¹
Clase DEH	11,2740 ¹	11,2144 ¹	11,1182 ¹
Clase DG	12,1617	11,9968	11,6992
Clase DGP	9,8895	9,9693	10,0965
Clase IE	13,8733 ¹	13,3960 ¹	13,3535 ¹
Clase IEH	12,6806 ¹	12,5067 ¹	12,1998 ¹
Clase IG	13,7115	13,4114	12,8573
Clase IGP	10,7548	10,7517	10,7015
Clase IU	13,1127 ³	12,9928 ³	13,2640 ³
Clase IUH	14,1019 ³	13,7584 ³	13,0077 ³
Clase LG	13,8493	13,5361	12,9575
Clase LGP	10,8359	10,8271	10,7649
Clase ZE	13,6889 ¹	13,2311 ¹	13,2156 ¹
Clase ZEH	12,5188 ¹	12,3577 ¹	12,0729 ¹
Clase ZFH	12,1292 ⁴	12,1009 ⁴	11,8925 ⁴
Clase ZG	13,5100	13,2275	12,7064
Clase ZGP	11,1283	11,1391	11,1107
Clase ZUH	14,3943 ³	14,0566 ³	13,3271 ³
Clase 1EH	11,7976 ¹	11,6827 ¹	11,4780 ¹
Clase 1FH	11,5351 ⁴	11,5429 ⁴	11,4101 ⁴
Clase 1UH	13,1002 ³	12,8308 ³	12,2298 ³
Clase 3EH	12,2499 ¹	12,0836 ¹	11,7863 ¹
Clase 3FH	11,9735 ⁴	11,9357 ⁴	11,7136 ⁴
Clase 3UH	13,6104 ³	13,2761 ³	12,5625 ³
Clase 9EH	12,2788 ¹	12,1085 ¹	11,7980 ¹
Clase 9FH	11,9723 ⁴	11,9323 ⁴	11,7077 ⁴
Clase 9G	12,2577	11,9888	11,4924
Clase 9UH	13,6193 ³	13,2859 ³	12,5653 ³

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

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

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

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

Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha*

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	21 de julio de 2023*	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase AEH	14,9809 ¹	14,8309 ¹	15,5801 ¹
Clase AFH	13,4634 ²	13,3909 ²	14,1612 ²
Clase AGH	16,4445 ³	16,1906 ³	16,7573 ³
Clase AU	17,5942	17,2876	17,6966
Clase DEH	11,4654 ¹	11,3655 ¹	12,0140 ¹
Clase DU	13,3790	13,1644	13,5433
Clase IEH	22,1317 ¹	21,8492 ¹	22,7694 ¹
Clase IGH	24,0215 ³	23,6037 ³	24,2352 ³
Clase IU	25,6696	25,1613	25,5384
Clase XGH	–	10,6525 ³	10,8426 ³
Clase ZE	–	11,1038 ¹	11,0174 ¹
Clase ZEH	–	9,4994 ¹	9,9289 ¹
Clase ZGH	16,4834 ³	16,1995 ³	16,6367 ³
Clase ZU	–	10,4522	10,6198

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

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

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

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 21 de julio de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		19.637.404
Ingresos		
Dividendos, neto	2	6.597
Interés bancario	2	12.057
Ingresos por intereses en swaps		53.269
Ingresos por intereses en contratos de futuros		5.213
Total de ingresos		77.136
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(42.148)
Interés bancario	2	(1.162)
Dividendos pagados en swaps		(15.134)
Gastos por intereses en swaps		(34.800)
Gastos operativos	3, 5	(8.650)
Total de gastos		(101.894)
(Pérdida) neta de inversiones		(24.758)
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		1.179.050
(Pérdida) neta realizada en swaps		(429.597)
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		257.083
(Pérdida) neta realizada en contratos de futuros		(1.050.060)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		53.242
Ganancia neta realizada		9.718
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(594.248)
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		263.301
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(187.055)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		613.670
Cambio neto en ganancia no realizada		95.668
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		80.628
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		429.615
Reembolsos de acciones		(20.147.647)
Total de movimientos de capital		(19.718.032)
Patrimonio neto al final del periodo		–

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	21 de julio de 2023*	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
USD	–	19.637.404	24.741.485

* Consulte la nota 1.

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	214.555.554
Efectivo en el banco	2	12.259.406
Por cobrar para la venta de inversiones		1.549.702
Suscripciones por cobrar		23.636
Interés por cobrar en swaps	2	243.634
Interés y dividendos por cobrar, neto		3.035.107
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	12.362
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	904.950
Otros activos		15.925
Total de activos		232.600.276
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(5.831.260)
Reembolsos pagaderos		(529.566)
Interés pagadero en swaps	2	(364.707)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(3.667.174)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(119.754)
Otros pasivos		(20.237)
Total de pasivos		(10.532.698)
Total de patrimonio neto		222.067.578

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	927,754
Clase IE	85,000
Clase ZE	32.757,289
Clase 1E	7.584.773,181
Clase 1EP	50.399,520
Clase 1GH	124.510,574
Clase 1UH	184.978,506
Clase 2E	6.076.178,253
Clase 2EP	90,000
Clase 2GC	76,000
Clase 2GH	7.356,812
Clase 4GH	95.381,668
Clase 8E	8.092.271,283
Clase 8EP	128.939,769
Clase 8GC	1.246,784
Clase 8GH	349.547,981

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		431.287.517
Ingresos		
Dividendos, neto	2	14.776
Interés sobre bonos, neto	2	5.952.196
Interés bancario	2	118.600
Ingresos por intereses en swaps		4.153.920
Ingresos por intereses en contratos de futuros		371.325
Otros ingresos		76
Total de ingresos		10.610.893
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(925.854)
Gastos por intereses en swaps		(7.469.218)
Ingresos por intereses en contratos de futuros		(302.038)
Gastos operativos	3, 5	(153.229)
Total de gastos		(8.850.339)
Ingresos netos de inversiones		1.760.554
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(24.288.382)
(Pérdida) neta realizada en swaps		(2.946.580)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(2.424.066)
(Pérdida) neta realizada en contratos de futuros		(3.647.126)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		728.956
(Pérdida) neta realizada		(32.577.198)
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		27.046.281
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		1.170.784
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(495.001)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		6.490.849
Cambio neto en ganancia no realizada		34.212.913
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		3.396.269
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		9.481.599
Reembolsos de acciones		(222.097.807)
Total de movimientos de capital		(212.616.208)
Patrimonio neto al final del periodo		222.067.578

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
EUR	222.067.578	431.287.517	980.879.073

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase AE	9,4496	9,2862	9,7720
Clase IE	9,5645	9,3680	9,8024
Clase ZE	9,7369	9,5447	9,9967
Clase 1E	9,5385	9,3721	9,8622
Clase 1EP	8,0449	7,9045	8,7147
Clase 1GH	10,0351 ¹	9,7939 ¹	10,1307 ¹
Clase 1UH	10,4203 ²	10,1457 ²	10,4460 ²
Clase 2E	9,8397	9,6387	10,0810
Clase 2EP	8,2841	8,1165	8,8919
Clase 2GC	8,7127 ¹	8,4780 ¹	9,1211 ¹
Clase 2GH	10,3535 ¹	10,0735 ¹	10,3563 ¹
Clase 4GH	10,6214 ¹	10,3070 ¹	10,5443 ¹
Clase 8E	9,8159	9,6172	10,0626
Clase 8EP	8,2880	8,1203	8,8993
Clase 8GC	8,7146 ¹	8,4801 ¹	9,1415 ¹
Clase 8GH	10,3379 ¹	10,0599 ¹	10,3438 ¹

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

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

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	7.796.959
Efectivo en el banco	2	622.681
Por cobrar para la venta de inversiones		108.650
Interés por cobrar en swaps	2	5.995
Interés y dividendos por cobrar, neto		94.575
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	59.261
Total de activos		8.688.121
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(221.928)
Interés pagadero en swaps	2	(10.737)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(66.973)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(78.837)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(1.222)
Otros pasivos		(815)
Total de pasivos		(380.512)
Total de patrimonio neto		8.307.609

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	20.319,717
Clase AFH	92,200
Clase AKH	84,000
Clase ANH	830,000
Clase AUH	572,957
Clase DE	17.174,182
Clase IE	304.954,438
Clase IEP	89,999
Clase IGH	67,800
Clase INH	826,000
Clase IU	92,000
Clase IUH	90,000
Clase JE	80,997
Clase JGH	67,800
Clase JUH	91,000
Clase LE	9.581,001
Clase LEP	89,000
Clase LGH	67,800
Clase XE	79,000
Clase XGH	409.065,478
Clase XUH	92,000
Clase YE	82,001
Clase YGH	68,800
Clase YUH	91,000
Clase ZE	81,997
Clase ZFH	90,200
Clase ZGH	67,800
Clase ZUH	91,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		17.881.650
Ingresos		
Interés sobre bonos, neto	2	194.671
Interés bancario	2	5.011
Ingresos por intereses en swaps		118.826
Ingresos por intereses en contratos de futuros		22.673
Otros ingresos		1
Total de ingresos		341.182
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(7.862)
Gastos por intereses en swaps		(223.381)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(18.148)
Gastos operativos	3, 5	(6.593)
Total de gastos		(255.984)
Ingresos netos de inversiones		
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(901.509)
(Pérdida) neta realizada en swaps		(72.075)
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		238.093
(Pérdida) neta realizada en contratos de futuros		(112.728)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		2.270
(Pérdida) neta realizada		(845.949)
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		1.017.751
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en swaps		(27.330)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(146.754)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		344.146
Cambio neto en ganancia no realizada		1.187.813
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		427.062
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		108.741
Reembolsos de acciones		(10.109.800)
Dividendos	7	(44)
Total de movimientos de capital		(10.001.103)
Patrimonio neto al final del periodo		8.307.609

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
EUR	8.307.609	17.881.650	44.628.404

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase AE	9,5126	9,3843	9,9429
Clase AFH	9,2093 ¹	9,1791 ¹	9,8101 ¹
Clase AKH	95,7626 ²	94,5085 ²	99,6323 ²
Clase ANH	9,8434 ³	9,7009 ³	10,1446 ³
Clase AUH	10,5168 ⁴	10,2804 ⁴	10,6635 ⁴
Clase DE	9,2238	9,1244	9,7208
Clase IE	9,8584	9,6940	10,2044
Clase IEP	8,1693	8,2812	9,0524
Clase IGH	10,4094 ⁵	10,1721 ⁵	10,5320 ⁵
Clase INH	10,0526 ³	9,8776 ³	10,2572 ³
Clase IU	9,2410 ⁴	9,3333 ⁴	10,0660 ⁴
Clase IUH	10,8711 ⁴	10,5992 ⁴	10,9297 ⁴
Clase JE	9,8354	9,6769	10,1884
Clase JGH	10,4249 ⁵	10,1878 ⁵	10,5456 ⁵
Clase JUH	10,8345 ⁴	10,5575 ⁴	10,8783 ⁴
Clase LE	9,9378	9,7648	10,2635
Clase LEP	8,3067	8,4066	9,1580
Clase LGH	10,5305 ⁵	10,2762 ⁵	10,6048 ⁵
Clase XE	10,2838	10,0968	10,5895
Clase XGH	10,2432 ⁵	9,9837 ⁵	10,2913 ⁵
Clase XUH	10,7797 ⁴	10,4837 ⁴	10,7628 ⁴
Clase YE	9,7779	9,6238	10,1443
Clase YGH	10,3371 ⁵	10,1032 ⁵	10,4650 ⁵
Clase YUH	10,7469 ⁴	10,4761 ⁴	10,8066 ⁴
Clase ZE	9,7488	9,5978	10,1272
Clase ZFH	9,4420 ¹	9,3880 ¹	9,9880 ¹
Clase ZGH	10,3348 ⁵	10,1022 ⁵	10,4758 ⁵
Clase ZUH	10,8008 ⁴	10,5291 ⁴	10,8614 ⁴

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

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

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

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

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

Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	45.293.431
Efectivo en el banco	2	313.092
Suscripciones por cobrar		498
Interés por cobrar en swaps	2	1.098.402
Interés y dividendos por cobrar, neto		3.779
Ganancia neta no realizada en swaps	2, 10	13.323
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	78.695
Otros activos	20	252.475
Total de activos		47.053.695
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(20.050)
Interés pagadero en swaps	2	(880.394)
Dividendo pagadero en swaps	2	(9.906)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(1.779)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(51.874)
Otros pasivos		(11.434)
Total de pasivos		(975.437)
Total de patrimonio neto		46.078.258

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	1.291.319,420
Clase AEP	26.438,316
Clase AUH	77,000
Clase DE	1.399.095,316
Clase IE	583.271,177
Clase IGH	13.770,878
Clase LE	457.554,591
Clase XGH	52,000
Clase ZE	118.599,218
Clase ZF	76,000
Clase ZFH	77,000
Clase ZGH	57,000

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase AE	11,7680	12,3069	12,1389
Clase AEP	11,8198	12,3610	12,3867
Clase AUH	13,2615 ¹	13,7357 ¹	13,1642 ¹
Clase DE	11,3346	11,8833	11,7798
Clase IE	12,3972	12,9068	12,6164
Clase IGH	13,0183 ²	13,4607 ²	12,9699 ²
Clase LE	12,6657	13,1617	12,8174
Clase XGH	14,5064 ²	14,9610 ²	14,3002 ²
Clase ZE	12,4283	12,9456	12,6671
Clase ZF	10,6870 ³	11,4147 ³	11,5379 ³
Clase ZFH	11,4679 ³	12,0814 ³	11,9019 ³
Clase ZGH	13,1223 ²	13,5842 ²	13,1142 ²

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

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		78.085.915
Ingresos		
Dividendos, neto	2	859.079
Interés bancario	2	16.047
Ingresos por intereses en swaps		460.684
Ingresos por intereses en contratos de futuros		2.305
Otros ingresos		26
Total de ingresos		1.338.141
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(385.057)
Interés bancario	2	(2.685)
Dividendos pagados en swaps		(594.030)
Gastos por intereses en swaps		(156.536)
Gastos operativos	3, 5	(85.970)
Total de gastos		(1.224.278)
Ingresos netos de inversiones		113.863
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		3.889.253
(Pérdida) neta realizada en swaps		(2.947.225)
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		86.076
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		579.134
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(14.854)
Ganancia neta realizada		1.592.384
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(6.038.066)
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		1.761.734
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(48.918)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		78.695
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(4.246.555)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(2.540.308)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		2.373.639
Reembolsos de acciones		(31.840.988)
Total de movimientos de capital		(29.467.349)
Patrimonio neto al final del periodo		46.078.258

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
EUR	46.078.258	78.085.915	123.839.076

Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	50.059.320
Efectivo en el banco	2	919.899
Suscripciones por cobrar		4.403
Interés por cobrar en swaps	2	748.297
Interés y dividendos por cobrar, neto		31.555
Ganancia neta no realizada en swaps	2, 10	42.384
Otros activos		27
Total de activos		51.805.885
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(97.771)
Interés pagadero en swaps	2	(522.499)
Dividendo pagadero en swaps	2	(38.864)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(27.777)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(52.477)
Otros pasivos		(7.097)
Total de pasivos		(746.485)
Total de patrimonio neto		51.059.400

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	1.088,885
Clase AU	2.872,262
Clase DEH	343,599
Clase DU	16.973,317
Clase IU	206.623,481
Clase ZU	57,000
Clase 1E	3.012.860,931
Clase 1EH	345.747,459
Clase 1U	1.067.965,120
Clase 2E	49,023
Clase 2U	186,000
Clase 3U	45.196,000
Clase 8E	211.467,156
Clase 8U	1.310.894,732
Clase 9U	56,000

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase AEH	13,6227 ¹	13,5117 ¹	16,4272 ¹
Clase AU	15,1409	14,8565	17,4066
Clase DEH	13,2996 ¹	13,2239 ¹	16,1610 ¹
Clase DU	14,7814	14,5400	17,1211
Clase IU	15,7932	15,4273	17,9132
Clase ZU	15,6647	15,3226	17,8411
Clase 1E	7,4353 ¹	7,1058 ¹	8,1204 ¹
Clase 1EH	4,9667 ¹	4,9237 ¹	5,9805 ¹
Clase 1U	7,8707	7,7187	9,0336
Clase 2E	17,0556 ¹	16,2312 ¹	18,3931 ¹
Clase 2U	15,8661	15,4950	17,9863
Clase 3U	4,5022	4,3987	5,1096
Clase 8E	8,3149 ¹	7,9140 ¹	8,9701 ¹
Clase 8U	8,7491	8,5451	9,9191
Clase 9U	15,8218	15,4564	17,9452

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

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		88.870.969
Ingresos		
Dividendos, neto	2	196.577
Interés bancario	2	35.342
Ingresos por intereses en swaps		362.517
Total de ingresos		594.436
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(340.075)
Interés bancario	2	(6.792)
Dividendos pagados en swaps		(87.607)
Gastos por intereses en swaps		(268.526)
Gastos operativos	3, 5	(46.582)
Total de gastos		(749.582)
(Pérdida) neta de inversiones		(155.146)
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(2.456.533)
Ganancia neta realizada en swaps		331.058
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(19.614)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		891
(Pérdida) neta realizada		(2.144.198)
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		2.653.280
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		612.893
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(49.394)
Cambio neto en ganancia no realizada		3.216.779
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		917.435
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		1.941.201
Reembolsos de acciones		(40.670.205)
Total de movimientos de capital		(38.729.004)
Patrimonio neto al final del periodo		51.059.400

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
USD	51.059.400	88.870.969	125.198.445

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	72.632.883
Efectivo en el banco	2	3.210.576
Depósitos a plazo	2, 19	5.793.089
Suscripciones por cobrar		1.096
Interés por cobrar en swaps	2	736.100
Interés y dividendos por cobrar, neto		71.986
Otros activos	20	59.129
Total de activos		82.504.859
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(36.301)
Interés pagadero en swaps	2	(837.518)
Dividendo pagadero en swaps	2	(38.855)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(2.429)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(433.444)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(97.550)
Otros pasivos		(12.469)
Total de pasivos		(1.458.566)
Total de patrimonio neto		81.046.293

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	52,000
Clase AU	6.885,595
Clase DEH	12.023,296
Clase DU	618,597
Clase IU	60.443,891
Clase ZU	58,000
Clase 1E	13.712.918,427
Clase 1U	796.708,234
Clase 2E	52,000
Clase 2U	817,284
Clase 8E	312.860,170
Clase 8U	153.880,400

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase AEH	12,6444 ¹	12,3134 ¹	14,5886 ¹
Clase AU	14,0680	13,5426	15,4367
Clase DEH	12,4458 ¹	12,1476 ¹	14,4782 ¹
Clase DU	13,8171	13,3338	15,2753
Clase IU	14,8211	14,2037	16,0451
Clase ZU	14,6078	14,0143	15,8776
Clase 1E	5,0167 ¹	4,7036 ¹	5,2295 ¹
Clase 1U	5,3196	5,1181	5,8275
Clase 2E	15,8538 ¹	14,7996 ¹	16,3297 ¹
Clase 2U	14,7400	14,1217	15,9419
Clase 8E	5,6396 ¹	5,2661 ¹	5,8070 ¹
Clase 8U	6,0467	5,7939	6,5431

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

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		80.980.032
Ingresos		
Dividendos, neto	2	591.168
Interés bancario	2	191.710
Ingresos por intereses en swaps		407.302
Otros ingresos		61
Total de ingresos		1.190.241
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(613.042)
Interés bancario	2	(13.086)
Dividendos pagados en swaps		(89.663)
Gastos por intereses en swaps		(721.410)
Gastos operativos	3, 5	(78.532)
Total de gastos		(1.515.733)
(Pérdida) neta de inversiones		(325.492)
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		73.597
Ganancia neta realizada en swaps		3.569.916
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(5.970)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		11.879
Ganancia neta realizada		3.649.422
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		1.240.645
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en swaps		(1.287.224)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(4.123)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(50.702)
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		3.273.228
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		1.890.357
Reembolsos de acciones		(5.097.324)
Total de movimientos de capital		(3.206.967)
Patrimonio neto al final del periodo		81.046.293

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
USD	81.046.293	80.980.032	99.127.304

Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	170.516.389
Efectivo en el banco	2	10.527.475
Suscripciones por cobrar		111.263
Interés y dividendos por cobrar, neto		25.061
Total de activos		181.180.188
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(62.063)
Interés pagadero en swaps	2	(19.221)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(1.648.343)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(4.997.914)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(67.045)
Otros pasivos		(16.415)
Total de pasivos		(6.811.001)
Total de patrimonio neto		174.369.187

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	487.125,597
Clase AFH	236.637,729
Clase AGH	63.340,998
Clase ASH	667.716,524
Clase AU	533.358,244
Clase DEH	167.079,486
Clase DU	375.762,113
Clase IEH	374.413,451
Clase IG	64,000
Clase IGH	2.583.029,435
Clase IU	384.408,354
Clase NG	17.563,838
Clase XU	3.784.251,718
Clase ZEH	24.307,319
Clase ZFH	160,000
Clase ZGH	186.194,819
Clase ZU	32.601,137

ESTADO DEL VALOR LIQUIDATIVO POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
Clase AEH	10,5903 ¹	10,6456 ¹	12,2529 ¹
Clase AFH	7,6608 ²	7,7799 ²	9,0157 ²
Clase AGH	11,6143 ³	11,5943 ³	13,1736 ³
Clase ASH	6,1315 ⁴	6,1489 ⁴	6,9266 ⁴
Clase AU	13,1317	13,0569	14,5604
Clase DEH	7,9748 ¹	8,0276 ¹	9,2625 ¹
Clase DU	9,8937	9,8496	11,0114
Clase IEH	15,7727 ¹	15,8324 ¹	18,1687 ¹
Clase IG	15,0617 ³	14,7608 ³	15,4257 ³
Clase IGH	17,2618 ³	17,2065 ³	19,4921 ³
Clase IU	19,5378	19,3974	21,5661
Clase NG	14,6490 ³	14,3316 ³	14,9110 ³
Clase XU	21,0655	20,8308	22,9751
Clase ZEH	6,6587 ¹	6,6838 ¹	7,6710 ¹
Clase ZFH	6,3117 ²	6,3961 ²	7,3902 ²
Clase ZGH	9,8738 ³	9,8431 ³	11,1531 ³
Clase ZU	8,0531	7,9952	8,8906

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

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2023

	Notas	2023 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		199.455.534
Ingresos		
Interés sobre bonos, neto	2	4.218.564
Interés bancario	2	262.668
Total de ingresos		4.481.232
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(420.428)
Interés bancario	2	(24.060)
Gastos por intereses en swaps		(256.045)
Gastos operativos	3, 5	(106.599)
Total de gastos		(807.132)
Ingresos netos de inversiones		3.674.100
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(9.277)
Ganancia neta realizada en swaps		4.917.101
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		1.068.212
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		2.771
Ganancia neta realizada		5.978.807
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		70.238
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en swaps		(7.139.953)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(2.755.966)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(9.825.681)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(172.774)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		11.885.356
Reembolsos de acciones		(36.798.929)
Total de movimientos de capital		(24.913.573)
Patrimonio neto al final del periodo		174.369.187

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

USD	30 de septiembre de 2023	31 de marzo de 2023	31 de marzo de 2022
	174.369.187	199.455.534	547.084.733

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2023

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*				
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)							
Bonos				Bonos (continuación)							
AUSTRALIA				ISLAS CAIMÁN (continuación)							
EUR	4.108.000	APT Pipelines Limited 1.25% 15/03/2033	3.157.959	0,33	USD	1.200.000	Tencent Holdings Limited 3.93% 19/01/2038	913.064	0,10		
GBP	2.980.000	APT Pipelines Limited 4.25% 26/11/2024	3.555.798	0,37	Total de Islas Caimán				8.141.676	0,85	
EUR	2.019.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031	1.627.759	0,17	DINAMARCA						
EUR	1.330.000	Ausgrid Finance Pty Limited 1.25% 30/07/2025	1.329.572	0,14	GBP	2.842.000	Danske Bank A/S FRN 23/08/2028	3.521.306	0,37		
USD	1.916.000	Ausgrid Finance Pty Limited 4.35% 01/08/2028	1.790.324	0,19	Total de Dinamarca				3.521.306	0,37	
EUR	1.539.000	Goodman Australia 1.38% 27/09/2025	1.527.662	0,16	FINLANDIA						
EUR	9.148.000	NBN Company Limited 4.13% 15/03/2029	9.608.139	1,00	EUR	5.711.000	OP Corporate Bank plc 0.10% 16/11/2027	5.153.495	0,54		
USD	2.597.000	SGSP Australia Assets Pty 3.50% 07/07/2027	2.390.703	0,25	Total de Finlandia				5.153.495	0,54	
EUR	1.681.000	Telstra Group Limited 3.75% 04/05/2031	1.753.847	0,18	FRANCIA						
Total de Australia				26.741.763	2,79	EUR	3.200.000	BPCE SA FRN 13/10/2046	2.482.621	0,26	
BERMUDAS						GBP	5.500.000	Credit Agricole SA 4.88% 23/10/2029	6.394.137	0,67	
USD	3.135.000	Bacardi Limited 5.30% 15/05/2048	2.698.865	0,28	USD	2.117.000	Electricite de France SA 6.90% 23/05/2053	2.101.694	0,22		
Total de Bermudas				2.698.865	0,28	EUR	2.451.000	Forvia SE 2.38% 15/06/2029	2.119.058	0,23	
CANADÁ						EUR	2.300.000	Praemia Healthcare SACA 5.50% 19/09/2028	2.426.179	0,25	
USD	2.150.000	Cenovus Energy Inc. 3.75% 15/02/2052	1.417.001	0,15	EUR	2.600.000	SANEF SA 1.88% 16/03/2026	2.602.556	0,26		
USD	2.137.000	Enbridge Inc. 5.70% 08/03/2033	2.049.057	0,21	GBP	1.600.000	Societe Generale SA 6.25% 22/06/2033	1.970.940	0,21		
Total de Canadá				3.466.058	0,36	GBP	2.400.000	Suez SACA 6.63% 05/10/2043	2.929.410	0,31	
ISLAS CAIMÁN						Total de Francia				23.026.595	2,41
USD	732.000	Alibaba Group Holding Limited 4.00% 06/12/2037	568.951	0,06	ALEMANIA						
GBP	2.333.000	Southern Water Services Finance Limited 1.63% 30/03/2027	2.395.799	0,25	EUR	1.700.000	Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	1.457.316	0,15		
GBP	2.472.000	Southern Water Services Finance Limited 2.38% 28/05/2028	2.491.345	0,26	EUR	8.400.000	Amprion GmbH 0.63% 23/09/2033	6.323.287	0,66		
GBP	1.840.000	Southern Water Services Finance Limited 3.00% 28/05/2037	1.447.149	0,15	EUR	5.700.000	Amprion GmbH 3.88% 07/09/2028	5.976.517	0,63		
USD	566.000	Tencent Holdings Limited 3.24% 03/06/2050	325.368	0,03	EUR	2.500.000	Amprion GmbH 3.97% 22/09/2032	2.580.307	0,27		
					EUR	2.700.000	Bayer AG FRN 25/09/2083	2.830.413	0,30		
					EUR	3.900.000	Commerzbank AG FRN 29/12/2031	3.448.054	0,36		
					EUR	900.000	Commerzbank AG FRN 05/10/2033	940.866	0,10		
					EUR	884.000	Deutsche Bank AG FRN 10/06/2026	890.639	0,09		

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)			
ESPAÑA (continuación)				REINO UNIDO (continuación)			
USD	1.503.000 Telefonica Emisiones SA 5.21% 08/03/2047	1.197.838	0,13	GBP	1.163.000 Co-Operative Bank Finance plc FRN 24/05/2028	1.407.394	0,15
	Total de España	9.239.762	0,97	USD	6.993.000 Diageo Capital plc 5.50% 24/01/2033	7.015.181	0,74
SUECIA				EUR	3.633.000 DS Smith plc 0.88% 12/09/2026	3.474.296	0,36
EUR	3.521.000 Sagax AB 1.13% 30/01/2027	3.236.535	0,34	GBP	2.826.000 DS Smith plc 2.88% 26/07/2029	2.914.749	0,31
EUR	136.000 Sagax AB 2.00% 17/01/2024	142.428	0,01	EUR	2.893.000 DS Smith plc 4.38% 27/07/2027	3.056.731	0,32
	Total de Suecia	3.378.963	0,35	EUR	4.282.000 DS Smith plc 4.50% 27/07/2030	4.441.532	0,47
SUIZA				EUR	28.000 HBOS plc FRN 18/03/2030	29.041	0,00
EUR	1.346.000 Credit Suisse AG 0.25% 01/09/2028	1.171.319	0,12	EUR	569.000 HBOS plc FRN 18/03/2030	590.151	0,06
USD	4.470.000 Credit Suisse AG 5.00% 09/07/2027	4.302.217	0,45	USD	7.628.000 HSBC Holdings plc FRN 22/11/2032	5.869.925	0,62
USD	3.906.000 UBS Group AG FRN 14/05/2032	3.088.369	0,32	USD	2.899.000 HSBC Holdings plc FRN 11/08/2033	2.673.464	0,28
	Total de Suiza	8.561.905	0,89	USD	1.500.000 HSBC Holdings plc FRN 09/03/2034	1.468.776	0,15
REINO UNIDO				USD	1.591.000 HSBC Holdings plc FRN 09/03/2044	1.529.272	0,16
GBP	2.456.000 Anglian Water Osprey Financing plc 2.00% 31/07/2028	2.286.193	0,24	GBP	2.158.000 HSBC Holdings plc FRN 16/11/2034	2.727.592	0,29
EUR	1.459.000 Anglo American Capital plc 4.75% 21/09/2032	1.508.093	0,16	GBP	378.000 Legal & General Group plc FRN 01/11/2050	392.918	0,04
USD	691.000 Anglo American Capital plc 4.75% 16/03/2052	525.533	0,06	EUR	2.535.000 Lloyds Bank Corporate Markets 4.13% 30/05/2027	2.668.862	0,28
USD	11.062.000 Bae Systems plc 3.40% 15/04/2030	9.643.587	1,00	GBP	520.000 London Power Networks plc 6.13% 07/06/2027	642.259	0,07
USD	2.756.000 Barclays plc FRN 24/11/2032	2.076.996	0,22	GBP	2.200.000 National Gas Transmission plc 1.13% 14/01/2033	1.737.478	0,18
USD	2.314.000 Barclays plc FRN 09/08/2033	2.141.925	0,22	GBP	637.000 National Gas Transmission plc 5.75% 05/04/2035	740.872	0,08
USD	2.362.000 Barclays plc FRN 09/05/2034	2.239.752	0,23	EUR	2.038.000 National Grid Electricity Distribution East Midlands plc 3.95% 20/09/2032	2.055.788	0,22
USD	2.278.000 BP Capital Markets plc - Perp FRN	2.181.813	0,23	GBP	1.070.000 National Grid Electricity Distribution plc 3.50% 16/10/2026	1.222.377	0,13
EUR	2.269.000 BP Capital Markets plc - Perp FRN	2.249.182	0,24	EUR	780.000 National Grid Electricity Transmission plc 0.82% 07/07/2032	615.911	0,06
EUR	1.636.000 British American Tobacco plc - Perp FRN	1.487.697	0,16	EUR	5.808.000 National Grid Electricity Transmission plc 0.82% 07/07/2032	4.586.167	0,48
GBP	840.000 Broadgate Financing plc 5.00% 05/10/2031	968.812	0,10	GBP	1.077.000 National Grid Electricity Transmission plc 1.13% 07/07/2028	1.072.214	0,11
GBP	526.000 Broadgate Financing plc 5.10% 05/04/2033	569.818	0,06	EUR	3.177.000 Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	2.769.009	0,29
EUR	1.237.000 Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	1.029.857	0,11	USD	3.661.000 Nationwide Building Society 1.50% 13/10/2026	3.201.273	0,34
EUR	951.000 Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	791.750	0,08				
GBP	1.820.000 Cadent Finance plc 2.25% 10/10/2035	1.476.985	0,15				
GBP	400.000 Co-Operative Bank Finance plc FRN 06/04/2027	447.127	0,05				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
REINO UNIDO (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)					
GBP	1.654.000	NatWest Markets plc 6.38% 08/11/2027	2.042.868	0,21	USD	7.882.000	Astrazeneca Finance LLC 4.88% 03/03/2028	7.744.367	0,82
EUR	2.980.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	2.719.712	0,29	USD	6.040.000	AT&T Inc. 3.50% 15/09/2053	3.728.588	0,39
GBP	2.490.000	Northumbrian Water Finance plc 2.38% 05/10/2027	2.646.479	0,28	CAD	1.500.000	AT&T Inc. 4.00% 25/11/2025	1.068.065	0,11
GBP	1.126.000	Northumbrian Water Finance plc 6.38% 28/10/2034	1.358.590	0,14	GBP	400.000	AT&T Inc. 4.38% 14/09/2029	449.852	0,05
GBP	783.000	Phoenix Group Holdings plc 5.63% 28/04/2031	842.805	0,09	USD	2.300.000	AT&T Inc. 4.90% 15/08/2037	1.994.742	0,21
GBP	570.000	Santander UK plc - Perp 10.06%	921.116	0,10	USD	1.514.000	Bank of America Corp. FRN 21/07/2032	1.146.958	0,12
GBP	1.257.000	Telereal Securitisation plc FRN 10/12/2033	1.375.132	0,14	USD	1.814.000	Bank of America Corp. FRN 13/02/2031	1.456.500	0,15
GBP	528.552	Tesco Property Finance 1 plc 7.62% 13/07/2039	690.518	0,07	USD	4.769.000	Bank of America Corp. FRN 29/04/2031	3.836.267	0,40
GBP	817.802	Tesco Property Finance 3 plc 5.74% 13/04/2040	928.383	0,10	USD	7.825.000	Bank of America Corp. FRN 11/03/2032	6.166.361	0,65
GBP	1.706.000	Thames Water Kemble Finance plc 4.63% 19/05/2026	1.290.722	0,14	USD	6.787.000	Bank of America Corp. FRN 04/02/2033	5.353.822	0,56
EUR	3.407.000	Thames Water Utilities Finance plc 0.88% 31/01/2028	2.964.682	0,31	USD	1.669.000	Bank of America Corp. FRN 23/07/2030	1.427.963	0,15
EUR	6.780.000	Thames Water Utilities Finance plc 4.38% 18/01/2031	6.375.278	0,67	USD	1.573.000	BAT Capital Corp. 6.34% 02/08/2030	1.548.170	0,16
GBP	1.133.000	Virgin Money UK plc FRN 19/08/2031	1.186.006	0,12	USD	2.355.000	Bayer US Finance II LLC 4.63% 25/06/2038	1.927.872	0,20
GBP	700.000	Virgin Money UK plc FRN 22/06/2025	827.091	0,09	USD	6.236.000	Berkshire Hathaway Finance Corp. 3.85% 15/03/2052	4.668.473	0,48
EUR	2.812.000	Virgin Money UK plc FRN 29/10/2028	2.870.702	0,30	USD	2.011.000	Boeing Company 3.95% 01/08/2059	1.323.197	0,14
GBP	1.690.000	Virgin Money UK plc FRN 23/08/2029	2.095.655	0,22	USD	950.000	Boeing Company 5.93% 01/05/2060	853.966	0,09
GBP	1.282.000	Wessex Water Services Finance plc 5.13% 31/10/2032	1.447.576	0,15	USD	1.150.000	Broadcom Inc. 4.15% 15/11/2030	1.020.022	0,11
		Total de Reino Unido	123.111.667	12,92	USD	1.271.000	Charter Communications Operating LLC 3.90% 01/06/2052	760.527	0,08
					USD	2.314.000	Charter Communications Operating LLC 3.95% 30/06/2062	1.315.487	0,14
					USD	879.000	Commonwealth Edison Company 5.30% 01/02/2053	808.304	0,08
					USD	833.000	Connecticut Light and Power Company 5.25% 15/01/2053	759.690	0,08
ESTADOS UNIDOS					USD	168.000	CSX Corp. 3.80% 01/11/2046	122.684	0,01
USD	981.000	AEP Texas Inc. 3.45% 15/05/2051	623.922	0,07	USD	814.000	CSX Corp. 3.80% 15/04/2050	589.927	0,06
USD	6.055.000	Amazon.com Inc. 4.70% 01/12/2032	5.793.305	0,60	USD	1.893.000	CSX Corp. 4.50% 15/11/2052	1.541.115	0,17
USD	1.515.000	Amgen Inc. 2.20% 21/02/2027	1.360.167	0,14	EUR	3.770.000	Duke Energy Corp. 3.85% 15/06/2034	3.561.179	0,37
USD	2.025.000	Amgen Inc. 3.15% 21/02/2040	1.428.954	0,15	USD	701.000	Duke Energy Ohio Inc. 5.65% 01/04/2053	660.346	0,07
USD	932.000	Amgen Inc. 4.20% 22/02/2052	699.900	0,07	USD	3.871.000	Eaton Corp. 4.35% 18/05/2028	3.725.836	0,39
USD	673.000	Amgen Inc. 4.88% 01/03/2053	558.975	0,06	USD	1.077.000	Emera USA Finance LP 4.75% 15/06/2046	798.495	0,08
USD	4.143.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2030	4.049.222	0,42	USD	8.317.000	Eversource Energy 2.55% 15/03/2031	6.645.196	0,70
USD	8.600.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2033	8.231.961	0,87					
USD	1.326.000	Amgen Inc. 5.65% 02/03/2053	1.240.824	0,13					
USD	7.537.000	Amgen Inc. 5.75% 02/03/2063	6.967.005	0,73					
USD	3.651.000	Apple Inc. 4.00% 10/05/2028	3.509.059	0,37					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)			
ESTADOS UNIDOS (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
USD	2.396.000 Eversource Energy 4.20% 27/06/2024	2.366.019	0,25	EUR	4.160.000 Metropolitan Life Global Funding I 3.75% 05/12/2030	4.260.390	0,44
USD	2.567.000 Eversource Energy 5.45% 01/03/2028	2.536.910	0,27	GBP	2.156.000 Morgan Stanley FRN 18/11/2033	2.553.589	0,27
USD	2.224.000 Ford Motor Credit Company LLC 7.35% 04/11/2027	2.270.315	0,24	EUR	4.314.000 Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	4.341.173	0,46
USD	551.000 Georgia Power Company 3.70% 30/01/2050	386.478	0,04	EUR	2.740.000 Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	2.819.203	0,30
USD	1.043.000 Georgia Power Company 5.13% 15/05/2052	921.935	0,10	USD	2.343.000 NiSource Inc. 1.70% 15/02/2031	1.754.761	0,18
USD	398.000 Goldman USA Finance Three 3.70% 15/03/2028	357.452	0,04	USD	1.598.000 NiSource Inc. 4.38% 15/05/2047	1.231.117	0,13
USD	3.640.000 HCA Inc. 5.88% 01/02/2029	3.583.702	0,38	USD	7.009.000 NiSource Inc. 4.80% 15/02/2044	5.765.398	0,61
EUR	3.730.000 Honeywell International Inc. 3.75% 17/05/2032	3.812.891	0,40	USD	800.000 NiSource Inc. 5.00% 15/06/2052	666.889	0,07
EUR	2.621.000 Honeywell International Inc. 4.13% 02/11/2034	2.725.957	0,29	USD	1.189.000 NiSource Inc. 5.25% 30/03/2028	1.169.056	0,12
USD	1.098.000 Indiana Michigan Power Company 5.63% 01/04/2053	1.038.268	0,11	USD	3.797.000 NiSource Inc. 5.40% 30/06/2033	3.629.858	0,37
USD	256.000 Intel Corp. 4.75% 25/03/2050	212.542	0,02	USD	1.319.000 Oracle Corp. 3.60% 01/04/2040	946.536	0,10
USD	855.000 Intel Corp. 4.90% 05/08/2052	722.299	0,08	USD	1.346.000 Oracle Corp. 3.65% 25/03/2041	961.196	0,10
GBP	2.151.000 International Business Machines Corp. 4.88% 06/02/2038	2.322.350	0,24	USD	7.194.000 Pacific Gas and Electric Company 4.95% 01/07/2050	5.365.925	0,56
USD	1.918.000 JPMorgan Chase & Company FRN 04/02/2032	1.454.515	0,15	USD	1.174.000 Pacific Gas and Electric Company 6.75% 15/01/2053	1.102.502	0,12
USD	3.911.000 JPMorgan Chase & Company FRN 08/11/2032	3.037.171	0,32	USD	2.750.000 PacifiCorp 4.13% 15/01/2049	1.938.972	0,20
USD	9.930.000 JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2032	7.839.804	0,83	USD	718.000 Piedmont Natural Gas Company Inc. 3.35% 01/06/2050	445.313	0,05
USD	5.478.000 JPMorgan Chase & Company FRN 25/01/2033	4.370.553	0,46	USD	588.000 Plains All American Pipeline LP 3.55% 15/12/2029	505.895	0,05
USD	1.785.000 Kinder Morgan Energy Partners LP 5.00% 01/03/2043	1.442.309	0,15	USD	2.720.000 Plains All American Pipeline LP 4.70% 15/06/2044	2.012.865	0,21
USD	1.240.000 Kinder Morgan Inc. 5.20% 01/06/2033	1.146.660	0,12	USD	7.235.000 PNC Financial Services Group Inc. FRN 18/08/2034	6.957.464	0,74
GBP	1.405.000 Kraft Heinz Foods Company 4.13% 01/07/2027	1.632.847	0,17	USD	625.000 Public Service Company of Colorado 5.25% 01/04/2053	546.577	0,06
USD	2.002.000 L3Harris Technologies Inc. 5.40% 31/07/2033	1.925.360	0,20	USD	3.964.000 Public Service Electric and Gas Company 4.65% 15/03/2033	3.731.808	0,39
USD	1.910.000 Lowe's Companies Inc. 5.75% 01/07/2053	1.783.953	0,19	EUR	2.908.000 Realty Income Corp. 5.13% 06/07/2034	3.058.167	0,32
USD	4.086.000 Lowe's Companies Inc. 5.80% 15/09/2062	3.729.225	0,39	USD	1.503.000 RELX Capital Inc. 4.75% 20/05/2032	1.405.961	0,15
USD	810.000 LYB International Finance III LLC 4.20% 01/05/2050	571.372	0,06	USD	2.470.000 Republic Services Inc. 4.88% 01/04/2029	2.402.642	0,25
USD	3.000.000 LYB International Finance III LLC 5.63% 15/05/2033	2.893.513	0,31	USD	5.400.000 RTX Corp. 1.90% 01/09/2031	4.087.316	0,43
USD	6.349.000 Merck & Company Inc. 4.50% 17/05/2033	5.945.287	0,62	USD	3.000.000 RTX Corp. 5.15% 27/02/2033	2.843.975	0,30
				USD	516.000 Southern California Edison Company 3.65% 01/02/2050	349.027	0,04
				USD	744.000 Southern California Gas Company 3.95% 15/02/2050	528.267	0,06
				USD	1.820.000 Thermo Fisher Scientific Inc. 4.98% 10/08/2030	1.772.663	0,19
				GBP	2.744.000 Time Warner Cable Inc. 5.75% 02/06/2031	3.129.622	0,33
				USD	2.908.000 T-Mobile USA Inc. 2.63% 15/02/2029	2.476.185	0,26

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos (continuación)				Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)				
ESTADOS UNIDOS (continuación)				CANADÁ (continuación)				
USD	3.386.000 T-Mobile USA Inc. 2.88% 15/02/2031	2.754.054	0,29	CAD	5.293.000 Canada (Govt of) 2.75% 01/12/2048	3.218.473	0,34	
USD	3.732.000 T-Mobile USA Inc. 4.95% 15/03/2028	3.624.712	0,38	Total de Canadá			9.445.034	0,99
USD	1.901.000 T-Mobile USA Inc. 5.05% 15/07/2033	1.762.664	0,18	ALEMANIA				
USD	441.000 T-Mobile USA Inc. 5.80% 15/09/2062	399.664	0,04	EUR	571.000 Germany (Govt of) 0.00% 15/08/2052	261.205	0,03	
USD	2.866.000 UnitedHealth Group Inc. 4.50% 15/04/2033	2.654.170	0,28	EUR	3.118.000 Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.00% 15/09/2028	2.807.717	0,29	
USD	1.815.000 UnitedHealth Group Inc. 4.95% 15/05/2062	1.562.478	0,16	GBP	2.700.000 Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.88% 15/09/2026	2.935.107	0,31	
USD	5.608.000 UnitedHealth Group Inc. 5.30% 15/02/2030	5.579.345	0,59	GBP	4.900.000 Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 3.88% 02/09/2025	5.828.926	0,61	
USD	1.364.000 UnitedHealth Group Inc. 6.05% 15/02/2063	1.380.476	0,14	Total de Alemania			11.832.955	1,24
USD	4.039.000 Verizon Communications Inc. 4.40% 01/11/2034	3.511.734	0,37	JAPÓN				
USD	9.801.000 Warnermedia Holdings Inc. 5.14% 15/03/2052	7.294.066	0,77	JPY	549.600.000 Japan (Govt of) 0.40% 20/06/2049	2.757.226	0,29	
USD	2.727.000 Wells Fargo & Company FRN 24/04/2034	2.548.412	0,27	Total de Japón			2.757.226	0,29
USD	6.000.000 Wells Fargo & Company FRN 25/07/2034	5.682.658	0,60	SUPRANACIONAL				
USD	2.050.000 Western Midstream Operating LP 5.30% 01/03/2048	1.608.194	0,17	EUR	2.300.000 International Bank for Reconstruction & Development 0.00% 15/01/2027	2.182.555	0,23	
USD	4.644.000 Williams Cos Inc. 2.60% 15/03/2031	3.706.464	0,39	USD	5.465.000 International Bank for Reconstruction & Development 0.75% 11/03/2025	5.114.458	0,53	
USD	1.274.000 Williams Partners LP 4.85% 01/03/2048	1.022.527	0,11	USD	4.000.000 International Bank for Reconstruction & Development 0.75% 24/11/2027	3.408.510	0,36	
Total de Estados Unidos		282.348.882	29,66	Total de supranacional			10.705.523	1,12
Total de bonos		684.923.880	71,85	ESTADOS UNIDOS				
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				USD	12.261.000 United States Treasury N/B 1.13% 15/08/2040	6.972.486	0,73	
AUSTRALIA				USD	918.000 United States Treasury N/B 1.25% 15/05/2050	433.396	0,05	
AUD	1.770.000 Australia (Govt of) 1.75% 21/06/2051	604.821	0,06	USD	54.751.000 United States Treasury N/B 2.00% 15/11/2041	35.558.207	3,73	
Total de Australia		604.821	0,06	CANADÁ				
CANADÁ				CAD	9.302.000 Canada (Govt of) 1.00% 01/09/2026	6.226.561	0,65	

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)					
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)				Bonos (continuación)					
ESTADOS UNIDOS (continuación)				FRANCIA (continuación)					
USD	799.500	United States Treasury N/B 3.75% 31/05/2030	759.213	0,08	USD	2.317.000	BPCE SA 2.70% 01/10/2029	1.948.279	0,20
					USD	1.727.000	Credit Agricole SA 5.51% 05/07/2033	1.662.594	0,17
		Total de Estados Unidos	43.723.302	4,59			Total de Francia	9.215.702	0,96
		Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda	79.068.861	8,29			IRLANDA		
		Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	763.992.741	80,14	USD	1.978.000	AIB Group plc FRN 13/09/2029	1.973.395	0,21
		Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente					Total de Irlanda	1.973.395	0,21
		Bonos					ITALIA		
		AUSTRALIA			USD	2.050.000	Intesa Sanpaolo SpA 6.63% 20/06/2033	1.932.060	0,20
USD	2.913.000	APT Pipelines Limited 4.25% 15/07/2027	2.749.979	0,29			Total de Italia	1.932.060	0,20
USD	817.000	NBN Company Limited 2.63% 05/05/2031	658.213	0,07			PAÍSES BAJOS		
USD	3.689.000	NBN Company Limited 5.75% 06/10/2028	3.707.076	0,39	USD	279.000	E.ON International Finance BV 6.65% 30/04/2038	281.486	0,03
USD	7.087.000	Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	6.551.612	0,68	USD	409.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	409.000	0,04
		Total de Australia	13.666.880	1,43			Total de Países Bajos	690.486	0,07
		BÉLGICA					NORUEGA		
USD	4.411.000	KBC Group NV FRN 21/09/2034	4.286.833	0,45	USD	2.599.000	DNB Bank ASA 1.13% 16/09/2026	2.349.473	0,25
		Total de Bélgica	4.286.833	0,45	USD	200.000	DNB Bank ASA FRN 09/10/2026	199.012	0,02
		BERMUDAS					Total de Noruega	2.548.485	0,27
USD	1.000.000	Bacardi Limited 4.70% 15/05/2028	952.065	0,10			SUPRANACIONAL		
		Total de Bermudas	952.065	0,10	USD	6.088.000	Bacardi Limited 5.40% 15/06/2033	5.702.887	0,60
		DINAMARCA					Total de supranacional	5.702.887	0,60
USD	7.770.000	Danske Bank A/S 1.55% 10/09/2027	6.804.755	0,72			REINO UNIDO		
		Total de Dinamarca	6.804.755	0,72	USD	5.560.000	Experian Finance plc 2.75% 08/03/2030	4.599.157	0,48
		FRANCIA					Total de Reino Unido	4.599.157	0,48
USD	2.000.000	BNP Paribas SA FRN 13/01/2029	1.932.384	0,20			ESTADOS UNIDOS		
USD	3.780.000	BNP Paribas SA FRN 12/06/2029	3.672.445	0,39	USD	986.000	American Transmission Systems Inc. 2.65% 15/01/2032	781.299	0,08
					USD	1.936.000	Atlantic City Electric 2.30% 15/03/2031	1.539.898	0,16

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
ESTADOS UNIDOS (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)					
USD	7.026.000	BMW US Capital LLC 5.05% 11/08/2028	6.872.983	0,72	USD	940.000	Northwestern Mutual Life Insurance Company 3.85% 30/09/2047	669.576	0,07
USD	2.331.000	Broadcom Inc. 2.45% 15/02/2031	1.822.685	0,19	USD	4.100.000	Pacific Life Global Funding II 4.90% 04/04/2028	3.959.600	0,42
USD	1.352.000	Broadcom Inc. 4.93% 15/05/2037	1.164.990	0,12	USD	495.000	Peachtree Fund Trust 3.98% 15/02/2025	478.041	0,05
USD	5.623.000	Carrier Global Corp. 2.72% 15/02/2030	4.694.663	0,49	USD	3.450.000	Piedmont Natural Gas Co Inc. 5.40% 15/06/2033	3.295.896	0,35
USD	1.625.000	Daimler Truck Finance North America LLC 5.13% 19/01/2028	1.585.978	0,17	USD	7.116.000	Roche Holdings Inc. 1.93% 13/12/2028	6.078.702	0,64
USD	8.516.000	ERAC USA Finance LLC 4.60% 01/05/2028	8.175.593	0,86	USD	2.299.000	Stellantis Finance US Inc. 6.38% 12/09/2032	2.263.361	0,24
USD	1.773.000	ERAC USA Finance LLC 5.40% 01/05/2053	1.637.712	0,17	USD	2.991.000	Teachers Insurance & Annuity Association of America 4.27% 15/05/2047	2.282.548	0,24
USD	2.527.000	Five Corners Funding Trust III 5.79% 15/02/2033	2.475.271	0,26	USD	1.894.000	Teachers Insurance & Annuity Association of America 4.90% 15/09/2044	1.595.946	0,17
USD	3.920.000	GE HealthCare Technologies Inc. 5.86% 15/03/2030	3.889.728	0,41	USD	1.548.000	Verizon Communications Inc. 2.36% 15/03/2032	1.180.167	0,12
USD	637.000	Guardian Life Insurance Company of America 4.85% 24/01/2077	479.557	0,05	USD	5.747.000	Warnermedia Holdings Inc. 5.39% 15/03/2062	4.234.163	0,44
USD	3.141.000	HCA Inc. 3.63% 15/03/2032	2.600.940	0,27			Total de Estados Unidos	106.830.257	11,20
USD	1.200.000	HCA Inc. 4.63% 15/03/2052	899.868	0,09			Total de bonos	159.202.962	16,69
USD	2.439.000	Jersey Central Power & Light Company 2.75% 01/03/2032	1.913.363	0,20			Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente	159.202.962	16,69
USD	9.225.000	Mars Inc. 4.65% 20/04/2031	8.766.632	0,92			Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario		
USD	1.577.000	Metropolitan Edison Company 4.30% 15/01/2029	1.466.537	0,15			Bonos		
USD	883.000	Metropolitan Edison Company 5.20% 01/04/2028	862.543	0,09			CANADÁ		
USD	4.583.000	Metropolitan Life Global Funding I 1.55% 07/01/2031	3.451.027	0,36	CAD	1.980.000	Rogers Communications Inc. 3.65% 31/03/2027	1.361.551	0,14
USD	2.830.000	Metropolitan Life Global Funding I 5.15% 28/03/2033	2.686.646	0,28			Total de Canadá	1.361.551	0,14
USD	7.545.000	Nestle Holdings Inc. 5.00% 14/03/2028	7.505.661	0,79					
USD	7.500.000	Nestle Holdings Inc. 5.00% 12/09/2028	7.458.243	0,78					
USD	2.699.000	New York Life Global Funding 4.55% 28/01/2033	2.478.496	0,26					
USD	2.241.000	New York Life Global Funding 4.85% 09/01/2028	2.190.435	0,23					
USD	553.000	New York Life Insurance Company 4.45% 04/04/2069	406.579	0,04					
USD	3.960.000	Northwestern Mutual Life Insurance Company 3.45% 30/03/2051	2.550.511	0,27					
USD	682.000	Northwestern Mutual Life Insurance Company 3.63% 30/09/2059	434.419	0,05					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario (continuación)			
Bonos (continuación)			
PORTUGAL			
EUR	200.000 Banco Espirito Santo SA 0.00% 21/01/2099**	35.998	0,00
	Total de Portugal	35.998	0,00
	Total de bonos	1.397.549	0,14
	Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario	1.397.549	0,14
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
	3.983 BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	3.983	0,00
	Total de Irlanda	3.983	0,00
	Total de fondos	3.983	0,00
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	3.983	0,00
	Valor total de las inversiones	924.597.235	96,97

(Coste total: 1.019.555.488 USD)

* Diferencias menores debido al redondeo.

** Título a su valor razonable.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)			
ALEMANIA (continuación)				IRLANDA (continuación)			
EUR	200.000 Allianz SE FRN 05/07/2052	182.058	0,24	EUR	163.000 Bank of Ireland Group plc FRN 04/07/2031	162.934	0,21
EUR	300.000 Allianz SE FRN 25/07/2053	302.589	0,39	EUR	511.000 CRH SMW Finance DAC 4.00% 11/07/2031	498.170	0,65
EUR	600.000 Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	485.806	0,63	EUR	355.000 Experian Europe DAC 1.56% 16/05/2031	298.114	0,39
EUR	1.000.000 Ampriion GmbH 0.63% 23/09/2033	711.001	0,93	EUR	581.000 Permanent TSB Group Holdings plc FRN 25/04/2028	588.257	0,77
EUR	500.000 Ampriion GmbH 3.88% 07/09/2028	495.165	0,65		Total de Irlanda	2.054.987	2,69
EUR	100.000 Ampriion GmbH 3.97% 22/09/2032	97.485	0,13	ITALIA			
EUR	700.000 BASF SE 4.00% 08/03/2029	700.633	0,92	EUR	214.000 Aeroporti di Roma SpA 1.75% 30/07/2031	170.941	0,22
EUR	194.000 Bayer AG 4.63% 26/05/2033	192.221	0,25	EUR	200.000 Assicurazioni Generali SpA 5.40% 20/04/2033	198.493	0,26
EUR	200.000 Bayer AG FRN 25/09/2083	198.026	0,26	EUR	149.000 Autostrade per l'Italia SpA 2.00% 04/12/2028	130.662	0,17
EUR	400.000 Commerzbank AG FRN 29/12/2031	334.023	0,44	EUR	358.000 Autostrade per l'Italia SpA 2.25% 25/01/2032	287.525	0,37
EUR	300.000 Commerzbank AG FRN 18/01/2030	295.937	0,39	EUR	100.000 Autostrade per l'Italia SpA 4.75% 24/01/2031	97.265	0,13
EUR	200.000 Commerzbank AG FRN 05/10/2033	197.479	0,26	EUR	309.000 Snam SpA 0.00% 15/08/2025	286.418	0,37
EUR	700.000 Deutsche Bank AG FRN 19/11/2030	555.475	0,72		Total de Italia	1.171.304	1,52
EUR	200.000 Deutsche Bank AG FRN 05/09/2030	192.745	0,25	JAPÓN			
EUR	400.000 Hamburg Commercial Bank AG 4.88% 30/03/2027	395.990	0,52	EUR	512.000 Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0.01% 10/09/2025	472.948	0,62
EUR	400.000 Hannover Rueck SE FRN 26/08/2043	407.616	0,53		Total de Japón	472.948	0,62
EUR	400.000 Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	308.094	0,40	JERSEY - ISLAS DEL CANAL			
EUR	400.000 Vier Gas Transport GmbH 0.13% 10/09/2029	316.379	0,41	EUR	357.000 Heathrow Funding Limited 4.50% 11/07/2033	350.393	0,46
EUR	600.000 Vier Gas Transport GmbH 4.63% 26/09/2032	606.747	0,79		Total de Jersey - Islas del Canal	350.393	0,46
EUR	433.000 Volkswagen Leasing GmbH 4.75% 25/09/2031	425.373	0,55	LUXEMBURGO			
EUR	300.000 Vonovia SE 1.50% 14/06/2041	164.596	0,21	EUR	600.000 Aroundtown SA 0.38% 15/04/2027	457.325	0,60
EUR	300.000 Vonovia SE 1.88% 28/06/2028	261.968	0,34	EUR	600.000 Aroundtown SA 1.45% 09/07/2028	436.627	0,57
EUR	300.000 Vonovia SE 5.00% 23/11/2030	296.270	0,39	EUR	300.000 Aroundtown SA 1.63% 31/01/2028	228.001	0,30
	Total de Alemania	8.450.171	11,03	EUR	1.200.000 Grand City Properties SA 0.13% 11/01/2028	918.893	1,19
GRECIA				EUR	433.000 Medtronic Global Holdings SCA 1.38% 15/10/2040	275.368	0,36
EUR	157.000 Eurobank SA FRN 26/01/2029	163.763	0,21	EUR	521.000 P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	414.525	0,54
	Total de Grecia	163.763	0,21	IRLANDA			
IRLANDA				EUR	370.000 Aib Group plc FRN 30/05/2031	342.132	0,45
EUR	186.000 Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	165.380	0,22				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
LUXEMBURGO (continuación)				PAÍSES BAJOS (continuación)					
EUR	370.000	Prologis International Funding II SA 4.63% 21/02/2035	349.961	0,46	EUR	200.000	Telefonica Europe BV - Perp FRN	197.752	0,26
EUR	825.000	SELP Finance Sarl 3.75% 10/08/2027	787.346	1,03	EUR	100.000	Telefonica Europe BV - Perp FRN	102.872	0,13
	Total de Luxemburgo		3.868.046	5,05	EUR	485.000	TenneT Holding BV 1.63% 17/11/2026	463.962	0,60
					EUR	463.000	TenneT Holding BV 2.13% 17/11/2029	432.675	0,56
PAÍSES BAJOS				NORUEGA					
EUR	100.000	ABB Finance BV 3.25% 16/01/2027	98.241	0,13	EUR	380.000	TenneT Holding BV 4.50% 28/10/2034	400.545	0,52
EUR	176.000	Achmea BV 3.63% 29/11/2025	174.069	0,23	EUR	437.000	TenneT Holding BV - Perp FRN	413.750	0,54
EUR	200.000	Airbus SE 2.38% 09/06/2040	149.190	0,19	EUR	400.000	Triodos Bank NV FRN	300.904	0,39
EUR	265.000	Alliander NV 2.63% 09/09/2027	254.863	0,33	GBP	1.200.000	Volkswagen Financial Services NV 1.38% 14/09/2028	1.105.230	1,44
EUR	300.000	Allianz Finance II BV 0.00% 22/11/2026	268.618	0,35	EUR	300.000	Vonovia Finance BV 1.00% 28/01/2041	152.819	0,20
EUR	194.000	ASR Nederland NV FRN 07/12/2043	199.578	0,26	EUR	249.000	Wolters Kluwer NV 3.00% 23/09/2026	243.450	0,32
EUR	293.000	BMW Finance NV 4.13% 04/10/2033	293.471	0,38	EUR	234.000	Wolters Kluwer NV 3.75% 03/04/2031	228.533	0,30
EUR	302.000	Diageo Capital BV 1.88% 08/06/2034	246.237	0,32		Total de Países Bajos	11.655.959	15,17	
EUR	538.000	Digital Dutch Finco BV 1.50% 15/03/2030	434.935	0,57		NORUEGA			
EUR	160.000	Digital Intrepid Holding BV 1.38% 18/07/2032	117.614	0,15	EUR	679.000	DNB Bank ASA FRN 14/03/2029	674.921	0,88
EUR	345.000	Digital Intrepid Holding BV 1.38% 18/07/2032	253.605	0,33		Total de Noruega	674.921	0,88	
EUR	320.000	Enexis Holding NV 0.63% 17/06/2032	246.630	0,32		PORTUGAL			
EUR	327.000	Enexis Holding NV 0.75% 02/07/2031	261.923	0,34	EUR	100.000	Caixa Geral de Depositos SA FRN 31/10/2028	103.323	0,13
EUR	300.000	ING Groep NV FRN 01/02/2030	237.518	0,31		Total de Portugal	103.323	0,13	
EUR	300.000	ING Groep NV FRN 29/11/2030	240.915	0,31		ESPAÑA			
EUR	500.000	ING Groep NV FRN 16/02/2031	420.850	0,55	EUR	100.000	Banco de Sabadell SA FRN 07/06/2029	99.766	0,13
EUR	937.000	RELX Finance BV 1.00% 22/03/2024	922.163	1,20	EUR	200.000	Banco de Sabadell SA FRN 07/06/2029	199.532	0,26
EUR	345.000	Sagax Euro MTN BV 0.75% 26/01/2028	276.080	0,36	EUR	100.000	Banco de Sabadell SA FRN 10/11/2028	100.772	0,13
EUR	345.000	Shell International Finance BV 1.88% 07/04/2032	292.309	0,38		Total de España	400.070	0,52	
EUR	700.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 3.38% 24/08/2031	681.070	0,89		SUECIA			
EUR	909.000	Stedin Holding NV 0.50% 14/11/2029	741.442	0,97	EUR	606.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	526.130	0,69
EUR	199.000	Stedin Holding NV 2.38% 03/06/2030	179.924	0,23		Total de Suecia	526.130	0,69	
EUR	717.000	Stedin Holding NV - Perp FRN	622.222	0,81					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
SUIZA				REINO UNIDO (continuación)					
EUR	874.000	Credit Suisse AG 0.25% 01/09/2028	718.370	0,94	EUR	368.000	National Grid Electricity Transmission plc 0.82% 07/07/2032	274.459	0,36
EUR	387.000	UBS Group AG 0.63% 18/01/2033	263.990	0,34	EUR	417.000	Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	343.281	0,45
EUR	5.000	UBS Group AG 0.63% 18/01/2033	3.411	0,00	USD	898.000	Nationwide Building Society 1.50% 13/10/2026	741.662	0,96
	Total de Suiza	985.771	1,28	USD	576.000	NatWest Markets plc 1.60% 29/09/2026	478.120	0,62	
				GBP	290.000	NatWest Markets plc 6.38% 08/11/2027	338.306	0,44	
REINO UNIDO				EUR	295.000	Thames Water Utilities Finance plc 0.88% 31/01/2028	242.457	0,32	
EUR	213.000	Anglo American Capital plc 4.75% 21/09/2032	207.950	0,27	EUR	680.000	Thames Water Utilities Finance plc 4.38% 18/01/2031	603.928	0,79
EUR	336.000	Barclays plc FRN 12/05/2032	252.084	0,33	GBP	820.000	Virgin Money UK plc FRN 24/04/2026	887.898	1,16
EUR	173.000	Barclays plc FRN 12/05/2032	129.793	0,17	EUR	167.000	Virgin Money UK plc FRN 29/10/2028	161.026	0,21
EUR	534.000	BP Capital Markets plc - Perp FRN	499.963	0,65		Total de Reino Unido	11.166.357	14,57	
EUR	415.000	British American Tobacco plc - Perp FRN	356.440	0,46	ESTADOS UNIDOS				
EUR	345.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	271.289	0,36	EUR	341.000	Air Products and Chemicals Inc. 4.00% 03/03/2035	332.033	0,43
EUR	51.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	40.104	0,05	USD	353.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2030	325.865	0,43
GBP	458.733	Delamare Finance plc 5.55% 19/02/2029	514.061	0,67	USD	324.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2033	292.925	0,38
EUR	420.000	Diageo Finance plc 0.50% 19/06/2024	409.611	0,54	EUR	200.000	AT&T Inc. 1.80% 14/09/2039	132.273	0,17
EUR	330.000	Diageo Finance plc 1.00% 22/04/2025	315.431	0,41	EUR	81.000	AT&T Inc. 1.80% 14/09/2039	53.571	0,07
EUR	332.000	DS Smith plc 0.88% 12/09/2026	299.879	0,39	EUR	227.000	AT&T Inc. 3.15% 04/09/2036	190.385	0,25
EUR	254.000	DS Smith plc 4.38% 27/07/2027	253.483	0,33	EUR	345.000	Bank of America Corp. FRN 22/03/2031	270.451	0,35
EUR	504.000	DS Smith plc 4.50% 27/07/2030	493.768	0,65	EUR	242.000	Bank of America Corp. FRN 22/03/2031	189.708	0,25
EUR	415.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	406.542	0,53	EUR	277.000	Bank of America Corp. FRN 27/04/2033	241.467	0,31
USD	784.000	HSBC Holdings plc FRN 11/08/2033	682.887	0,89	EUR	185.000	Exxon Mobil Corp. 0.52% 26/06/2028	159.552	0,21
GBP	234.000	HSBC Holdings plc FRN 14/09/2031	272.210	0,35	EUR	570.000	Honeywell International Inc. 4.13% 02/11/2034	559.930	0,73
EUR	475.000	Imperial Brands Finance plc 3.38% 26/02/2026	465.212	0,61	EUR	368.000	International Business Machines Corp. 3.63% 06/02/2031	356.478	0,46
EUR	257.000	Lloyds Bank Corporate Markets 4.13% 30/05/2027	255.557	0,33	EUR	486.000	JPMorgan Chase & Company FRN 17/02/2033	357.521	0,47
EUR	328.000	Motability Operations Group plc 0.13% 20/07/2028	273.539	0,36	EUR	323.000	JPMorgan Chase & Company FRN 23/03/2030	284.408	0,37
EUR	416.000	National Grid Electricity Distribution East Midlands plc 3.95% 20/09/2032	396.346	0,52	EUR	688.000	Metropolitan Life Global Funding I 3.75% 05/12/2030	665.505	0,87
EUR	401.000	National Grid Electricity Transmission plc 0.82% 07/07/2032	299.071	0,39					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario			
Bonos			
PORTUGAL			
EUR	600.000	Banco Espirito Santo SA 0.00% 21/01/2099**	102.000 0,13
	Total de Portugal	102.000	0,13
REINO UNIDO			
EUR	350.000	Lehman Brothers UK Capital Funding III LP - Perp 3.88%	67.471 0,09
	Total de Reino Unido	67.471	0,09
	Total de bonos	169.471	0,22
	Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario	169.471	0,22
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
	52	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	5.276 0,01
	Total de Irlanda	5.276	0,01
	Total de fondos	5.276	0,01
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	5.276	0,01
	Valor total de las inversiones	75.233.851	98,10

(Coste total: 81.603.384 EUR)

* Diferencias menores debido al redondeo.

** Titulo a su valor razonable.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2023

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos				Bonos (continuación)					
BÉLGICA				FRANCIA (continuación)					
EUR	944.000	Azelis Finance NV 5.75% 15/03/2028	947.018	0,28	GBP	1.100.000	Electricite de France SA - Perp FRN	1.062.296	0,32
EUR	3.100.000	Belfius Bank SA - Perp FRN	3.100.356	0,93	EUR	600.000	Electricite de France SA - Perp FRN	611.477	0,18
EUR	800.000	Solvay SA - Perp FRN	742.795	0,22	EUR	1.020.000	Elior Group SA 3.75% 15/07/2026	806.732	0,24
EUR	300.000	Solvay SA - Perp FRN	299.171	0,09	EUR	576.000	Emeria SASU 3.38% 31/03/2028	464.244	0,14
	Total de Bélgica	5.089.340	1,52	EUR	1.428.000	Emeria SASU 7.75% 31/03/2028	1.329.518	0,40	
				EUR	4.003.000	Forvia SE 2.38% 15/06/2027	3.522.093	1,05	
CANADÁ				EUR	100.000	Forvia SE 2.38% 15/06/2029	81.659	0,02	
EUR	983.000	Primo Water Holdings Inc. 3.88% 31/10/2028	888.612	0,26	EUR	1.876.000	Forvia SE 2.75% 15/02/2027	1.693.484	0,50
	Total de Canadá	888.612	0,26	EUR	294.000	Forvia SE 3.75% 15/06/2028	264.665	0,08	
				EUR	633.000	Forvia SE 7.25% 15/06/2026	653.820	0,19	
FRANCIA				EUR	1.096.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	1.068.996	0,32	
EUR	400.000	Accor SA - Perp FRN	397.207	0,12	EUR	3.379.000	Iliad Holding SASU 5.13% 15/10/2026	3.219.954	0,96
EUR	300.000	Altice France SA 2.50% 15/01/2025	285.009	0,08	EUR	685.000	Iliad Holding SASU 5.63% 15/10/2028	638.727	0,19
EUR	1.075.000	Altice France SA 3.38% 15/01/2028	798.671	0,24	EUR	500.000	iliad SA 1.88% 11/02/2028	420.610	0,13
EUR	542.000	Altice France SA 4.00% 15/07/2029	390.402	0,12	EUR	1.100.000	iliad SA 5.38% 14/06/2027	1.071.595	0,31
EUR	561.000	Altice France SA 4.13% 15/01/2029	411.317	0,12	EUR	300.000	iliad SA 5.63% 15/02/2030	286.271	0,09
EUR	1.052.000	Altice France SA 4.25% 15/10/2029	761.270	0,23	EUR	300.000	Iliad SA 0.75% 11/02/2024	294.912	0,09
EUR	104.000	Altice France SA 4.25% 15/10/2029	75.259	0,02	EUR	400.000	Iliad SA 2.38% 17/06/2026	370.258	0,11
EUR	1.505.000	Altice France SA 5.88% 01/02/2027	1.297.631	0,39	EUR	578.000	Laboratoire Eimer SE 5.00% 01/02/2029	452.447	0,13
EUR	1.312.000	CAB Selas 3.38% 01/02/2028	1.099.017	0,33	EUR	1.778.000	Loxam SAS 3.25% 14/01/2025	1.749.151	0,53
EUR	2.000.000	Casino Guichard Perrachon SA 3.58% 07/02/2025	32.460	0,01	EUR	429.000	Loxam SAS 3.75% 15/07/2026	402.836	0,12
EUR	585.000	Casino Guichard Perrachon SA 6.63% 15/01/2026	9.116	0,00	EUR	305.000	Loxam SAS 5.75% 15/07/2027	284.269	0,08
EUR	334.000	Chrome Holding SASU 5.00% 31/05/2029	254.215	0,08	EUR	782.000	Paprec Holding SA 3.50% 01/07/2028	701.825	0,21
EUR	2.088.000	Constellium SE 3.13% 15/07/2029	1.776.394	0,53	EUR	1.001.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	984.932	0,29
EUR	2.600.000	Electricite de France SA - Perp FRN	2.143.518	0,64	EUR	1.031.000	Parts Europe SA 6.50% 16/07/2025	1.031.335	0,31
EUR	1.800.000	Electricite de France SA - Perp FRN	1.571.441	0,47	EUR	429.000	Picard Groupe SAS 3.88% 01/07/2026	398.954	0,12
EUR	400.000	Electricite de France SA - Perp FRN	309.341	0,09	EUR	400.000	Renault SA 2.00% 28/09/2026	365.499	0,11
EUR	2.900.000	Electricite de France SA - Perp FRN	2.776.446	0,82	EUR	800.000	Renault SA 2.38% 25/05/2026	742.936	0,22
EUR	2.100.000	Electricite de France SA - Perp FRN	2.052.152	0,61	EUR	400.000	Renault SA 2.50% 02/06/2027	362.833	0,11
				EUR	1.236.000	Rexel SA 2.13% 15/06/2028	1.091.017	0,32	
				EUR	857.000	Rexel SA 2.13% 15/12/2028	739.807	0,22	
				EUR	103.000	Rexel SA 2.13% 15/12/2028	88.915	0,03	
				EUR	831.000	Rexel SA 5.25% 15/09/2030	822.743	0,24	
				EUR	400.000	SPIE SA 2.63% 18/06/2026	379.219	0,11	
				EUR	300.000	Valeo SE 1.00% 03/08/2028	246.783	0,07	
				EUR	1.100.000	Valeo SE 5.38% 28/05/2027	1.101.179	0,33	
				EUR	600.000	Veolia Environnement SA - Perp FRN	504.254	0,15	
				EUR	1.100.000	Veolia Environnement SA - Perp FRN	999.406	0,29	

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
FRANCIA (continuación)				ALEMANIA (continuación)					
EUR	100.000	Veolia Environnement SA - Perp FRN	90.855	0,03	EUR	100.000	Ineos Styrolution Group GmbH 2.25% 16/01/2027	87.120	0,03
EUR	400.000	Veolia Environnement SA - Perp FRN	329.100	0,10	EUR	500.000	Infineon Technologies AG FRN 01/04/2168	478.271	0,14
	Total de Francia	48.172.472	14,34		EUR	500.000	Infineon Technologies AG FRN 01/04/2168	460.808	0,14
ALEMANIA					EUR	3.000.000	Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	2.310.704	0,69
EUR	500.000	Bayer AG FRN 12/05/2079	473.392	0,14	EUR	1.390.000	Novelis Sheet Ingot GmbH 3.38% 15/04/2029	1.203.444	0,36
EUR	1.000.000	Bayer AG FRN 12/11/2079	872.463	0,26	EUR	1.191.000	PCF GmbH 4.75% 15/04/2026	933.662	0,28
EUR	2.000.000	Bayer AG FRN 25/03/2082	1.875.882	0,56	EUR	1.106.000	Peach Property Finance GmbH 4.38% 15/11/2025	896.650	0,27
EUR	500.000	Bayer AG FRN 25/03/2082	460.214	0,14	EUR	1.500.000	Schaeffler AG 3.38% 12/10/2028	1.358.128	0,40
EUR	1.300.000	Bayer AG FRN 25/09/2083	1.287.280	0,38	EUR	700.000	Schaeffler AG 3.38% 12/10/2028	633.793	0,19
EUR	300.000	Bayer AG FRN 25/09/2083	297.039	0,09	EUR	1.061.192	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 6.00% 30/07/2026	1.036.642	0,31
EUR	1.749.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.50% 11/02/2027	1.597.585	0,48	EUR	1.395.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH 2.00% 15/07/2025	1.346.315	0,40
EUR	598.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 4.38% 15/01/2028	546.740	0,16	EUR	200.000	ZF Finance GmbH 2.00% 06/05/2027	175.571	0,05
EUR	162.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 4.38% 15/01/2028	148.113	0,04	EUR	1.100.000	ZF Finance GmbH 2.25% 03/05/2028	933.539	0,28
EUR	325.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 7.50% 15/05/2030	326.444	0,10	EUR	100.000	ZF Finance GmbH 2.75% 25/05/2027	89.488	0,03
EUR	877.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 7.50% 15/05/2030	879.686	0,26	EUR	1.000.000	ZF Finance GmbH 3.00% 21/09/2025	957.025	0,28
EUR	1.000.000	Commerzbank AG FRN 29/12/2031	835.057	0,25	EUR	1.000.000	ZF Finance GmbH 3.75% 21/09/2028	899.442	0,27
EUR	1.000.000	Commerzbank AG FRN 05/10/2033	987.397	0,29		Total de Alemania	36.070.255	10,74	
EUR	400.000	Deutsche Bank AG - Perp FRN	396.605	0,12	GIBRALTAR				
EUR	300.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 11/02/2025	290.006	0,09	EUR	2.406.000	888 Acquisitions Limited 7.56% 15/07/2027	2.229.365	0,66
EUR	2.900.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 16/05/2027	2.645.302	0,78		Total de Gibraltar	2.229.365	0,66	
EUR	1.800.000	Deutsche Lufthansa AG 3.00% 29/05/2026	1.691.678	0,50	GRECIA				
EUR	1.200.000	Deutsche Lufthansa AG 3.75% 11/02/2028	1.110.980	0,33	EUR	450.000	Eurobank SA FRN 05/05/2027	407.425	0,12
EUR	1.413.000	Gruenthal GmbH 3.63% 15/11/2026	1.343.111	0,40	EUR	1.595.000	Eurobank SA FRN 26/01/2029	1.663.705	0,50
EUR	804.000	Gruenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	743.673	0,22	EUR	980.000	National Bank of Greece SA FRN 03/01/2034	989.800	0,29
EUR	913.000	Gruenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	844.495	0,25		Total de Grecia	3.060.930	0,91	
EUR	214.000	Gruenthal GmbH 6.75% 15/05/2030	217.363	0,06	IRLANDA				
EUR	550.000	IHO Verwaltungs GmbH 3.88% 15/05/2027	498.782	0,15	EUR	957.000	AIB Group plc FRN 19/11/2029	911.415	0,27
EUR	1.839.417	IHO Verwaltungs GmbH 8.75% 15/05/2028	1.900.366	0,57					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
IRLANDA (continuación)				ITALIA (continuación)					
EUR	923.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	820.677	0,24	EUR	375.000	Telecom Italia SpA 2.88% 28/01/2026	349.781	0,10
EUR	1.909.000	Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	1.799.733	0,54	EUR	453.000	Telecom Italia SpA 3.63% 25/05/2026	432.511	0,13
EUR	1.216.000	Permanent TSB Group Holdings plc FRN 25/04/2028	1.231.187	0,37	EUR	204.000	Telecom Italia SpA 4.00% 11/04/2024	202.835	0,06
EUR	599.000	Permanent TSB Group Holdings plc FRN 30/06/2029	606.865	0,18	EUR	600.000	Telecom Italia SpA 5.25% 17/03/2055	481.343	0,14
GBP	1.047.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III 4.88% 15/07/2028	1.005.869	0,30	EUR	2.127.000	Telecom Italia SpA 6.88% 15/02/2028	2.140.072	0,64
		Total de Irlanda	6.375.746	1,90	EUR	1.412.000	Telecom Italia SpA 7.88% 31/07/2028	1.462.043	0,43
						Total de Italia	18.875.856	5,61	
ISLA DE MAN				JERSEY - ISLAS DEL CANAL					
EUR	119.000	Playtech plc 4.25% 07/03/2026	115.579	0,03	EUR	159.765	Adient Global Holdings Limited 3.50% 15/08/2024	157.261	0,05
		Total de Isla de Man	115.579	0,03	EUR	1.308.000	Avis Budget Finance plc 4.75% 30/01/2026	1.283.377	0,38
ITALIA				LUXEMBURGO					
EUR	633.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.00% 04/12/2028	555.096	0,17	EUR	608.000	Altice Financing SA 2.25% 15/01/2025	599.842	0,18
EUR	609.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1.88% 09/01/2026	546.527	0,16	EUR	1.366.000	Altice Financing SA 3.00% 15/01/2028	1.154.091	0,34
EUR	1.016.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 2.63% 28/04/2025	955.678	0,28	EUR	117.000	Altice Financing SA 4.25% 15/08/2029	97.642	0,03
EUR	824.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 3.63% 24/09/2024	803.957	0,24	EUR	1.165.000	Altice Finco SA 4.75% 15/01/2028	940.738	0,28
EUR	310.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA FRN 02/03/2026	307.831	0,09	EUR	631.000	Altice France Holding SA 4.00% 15/02/2028	299.339	0,09
EUR	900.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA FRN 05/09/2027	891.043	0,27	EUR	2.122.000	Altice France Holding SA 8.00% 15/05/2027	1.227.765	0,37
EUR	1.448.000	FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA 5.63% 01/08/2027	1.340.409	0,40	GBP	564.000	B&M European Value Retail SA 3.63% 15/07/2025	629.580	0,19
EUR	733.000	IMA Industria Macchine Automatiche SpA 3.75% 15/01/2028	652.622	0,19	EUR	2.089.000	Canpack SA 2.38% 01/11/2027	1.804.496	0,54
EUR	471.000	International Design Group SPA 6.50% 15/11/2025	457.253	0,14	EUR	257.000	Cirsa Finance International Sarl 4.75% 22/05/2025	254.991	0,08
EUR	1.451.000	Lottomatica SpA 7.13% 01/06/2028	1.485.432	0,45	EUR	960.000	Cirsa Finance International Sarl 7.88% 31/07/2028	966.597	0,29
EUR	1.068.000	Lottomatica SpA 9.75% 30/09/2027	1.153.404	0,34					
EUR	303.000	Marcolin SpA 6.13% 15/11/2026	285.271	0,08					
EUR	625.000	Mundys SpA 1.88% 12/02/2028	541.068	0,16					
EUR	938.000	Nexi SpA 2.13% 30/04/2029	781.670	0,23					
EUR	1.295.000	Telecom Italia SpA 2.38% 12/10/2027	1.128.311	0,34					
EUR	2.009.000	Telecom Italia SpA 2.75% 15/04/2025	1.921.699	0,57					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)			
SUECIA (continuación)				REINO UNIDO (continuación)			
EUR	486.000 Verisure Holding AB 3.88% 15/07/2026	458.203	0,14	EUR	396.000 Ineos Finance plc 3.38% 31/03/2026	373.719	0,11
EUR	305.000 Verisure Holding AB 7.13% 01/02/2028	308.728	0,09	EUR	2.074.000 Ineos Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	1.892.740	0,56
EUR	583.000 Verisure Holding AB 9.25% 15/10/2027	620.023	0,18	EUR	318.000 Ineos Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	290.208	0,09
EUR	1.932.000 Verisure Midholding A 5.25% 15/02/2029	1.699.844	0,51	GBP	1.030.000 Inspired Entertainment Financing plc 7.88% 01/06/2026	1.133.521	0,34
EUR	205.000 Verisure Midholding A 5.25% 15/02/2029	180.367	0,05	EUR	1.132.000 International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	1.083.449	0,32
	Total de Suecia	8.644.148	2,57	GBP	1.163.000 Iron Mountain UK plc 3.88% 15/11/2025	1.269.906	0,38
REINO UNIDO				EUR	929.000 Jaguar Land Rover Automotive plc 4.50% 15/07/2028	816.242	0,24
EUR	357.000 Allwyn Entertainment Financing UK plc 7.25% 30/04/2030	361.759	0,11	EUR	764.000 Jaguar Land Rover Automotive plc 5.88% 15/11/2024	765.811	0,23
GBP	340.000 Barclays plc FRN 14/11/2032	400.247	0,12	EUR	2.348.000 Jaguar Land Rover Automotive plc 6.88% 15/11/2026	2.364.886	0,71
GBP	523.000 Barclays plc - Perp FRN	552.652	0,16	GBP	578.000 Jerrold Finco plc 4.88% 15/01/2026	626.000	0,19
EUR	1.336.000 BCP V Modular Services Finance II plc 4.75% 30/11/2028	1.120.255	0,33	GBP	1.261.000 Jerrold Finco plc 5.25% 15/01/2027	1.295.970	0,39
GBP	3.285.000 Bellis Acquisition Company 3.25% 16/02/2026	3.301.119	0,99	GBP	1.034.000 Marks & Spencer plc 3.75% 19/05/2026	1.118.690	0,33
GBP	933.000 Bellis Acquisition Company plc 4.50% 16/02/2026	957.518	0,28	GBP	490.000 Marks & Spencer plc 6.00% 12/06/2025	560.378	0,17
GBP	473.000 Bellis Finco plc 4.00% 16/02/2027	418.115	0,12	GBP	435.000 NatWest Markets plc 6.38% 08/11/2027	507.459	0,15
GBP	1.438.000 Boparan Finance plc 7.63% 30/11/2025	1.135.184	0,34	EUR	1.173.000 Pinnacle Bidco plc 5.50% 15/02/2025	1.187.717	0,35
EUR	997.000 BP Capital Markets plc - Perp FRN	933.452	0,28	GBP	1.226.000 Pinnacle Bidco plc 6.38% 15/02/2025	1.412.356	0,42
EUR	584.000 BP Capital Markets plc - Perp FRN	509.792	0,15	EUR	1.674.000 Pinnacle Bidco plc 8.25% 11/10/2028	1.671.138	0,50
GBP	510.000 Centrica plc FRN 10/04/2075	566.022	0,17	GBP	781.000 Pinnacle Bidco plc 10.00% 11/10/2028	900.068	0,27
GBP	925.000 Co-Operative Bank Finance plc FRN 06/04/2027	976.605	0,29	GBP	747.000 Premier Foods Finance plc 3.50% 15/10/2026	787.544	0,23
GBP	833.000 Co-Operative Group FRN 08/07/2026	921.613	0,27	GBP	333.000 Punch Finance plc 6.13% 30/06/2026	340.749	0,10
GBP	100.000 Co-Operative Group Limited 5.13% 17/05/2024	114.317	0,03	EUR	791.000 Rolls-Royce plc 1.63% 09/05/2028	675.995	0,20
GBP	1.389.000 Deuce Finco plc 5.50% 15/06/2027	1.410.410	0,42	GBP	628.000 Rolls-Royce plc 3.38% 18/06/2026	663.544	0,20
EUR	1.159.000 EC Finance plc 3.00% 15/10/2026	1.081.320	0,32	GBP	1.973.000 Rolls-Royce plc 5.75% 15/10/2027	2.165.550	0,64
EUR	454.000 Ineos Finance plc 2.13% 15/11/2025	430.517	0,13	GBP	1.377.000 Santander UK plc - Perp 10.06%	2.101.745	0,64
EUR	1.919.000 Ineos Finance plc 2.88% 01/05/2026	1.784.996	0,53	EUR	1.383.000 Sherwood Financing plc 4.50% 15/11/2026	1.214.163	0,36
EUR	473.000 Ineos Finance plc 3.38% 31/03/2026	446.387	0,13				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)			
REINO UNIDO (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
EUR	1.982.000 Synthomer plc 3.88% 01/07/2025	1.896.864	0,56	EUR	1.697.000 Ford Motor Credit Company LLC 3.25% 15/09/2025	1.637.186	0,49
EUR	395.000 Victoria plc 3.63% 26/08/2026	313.057	0,09	GBP	951.000 Ford Motor Credit Company LLC 4.54% 06/03/2025	1.054.765	0,31
EUR	782.000 Victoria plc 3.75% 15/03/2028	573.531	0,17	EUR	1.582.000 Ford Motor Credit Company LLC 4.87% 03/08/2027	1.562.745	0,46
GBP	884.000 Virgin Media Secured Finance plc 4.13% 15/08/2030	805.183	0,24	GBP	1.296.000 Ford Motor Credit Company LLC 6.86% 05/06/2026	1.472.937	0,44
GBP	603.000 Virgin Media Secured Finance plc 4.25% 15/01/2030	559.045	0,17	EUR	2.785.000 IQVIA Inc. 2.25% 15/01/2028	2.444.883	0,73
GBP	865.000 Virgin Media Secured Finance plc 5.00% 15/04/2027	927.348	0,28	EUR	599.000 IQVIA Inc. 2.25% 15/03/2029	501.631	0,15
GBP	958.000 Virgin Media Secured Finance plc 5.25% 15/05/2029	955.488	0,28	EUR	342.000 IQVIA Inc. 2.25% 15/03/2029	286.407	0,09
EUR	1.852.000 Vmed O2 UK Financing 3.25% 31/01/2031	1.521.711	0,45	EUR	1.128.000 IQVIA Inc. 2.88% 15/06/2028	1.006.783	0,30
GBP	1.112.000 Vmed O2 UK Financing I plc 4.50% 15/07/2031	1.007.364	0,30	GBP	628.000 MPT Operating Partnership LP 2.50% 24/03/2026	552.707	0,16
EUR	875.000 Vodafone Group plc FRN 27/08/2080	799.639	0,24	GBP	648.000 MPT Operating Partnership LP 3.69% 05/06/2028	505.902	0,15
EUR	2.194.000 Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	2.026.840	0,60	USD	395.000 Occidental Petroleum Corp. 6.38% 01/09/2028	376.337	0,11
GBP	335.000 Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	364.639	0,11	USD	247.000 Occidental Petroleum Corp. 8.50% 15/07/2027	249.898	0,07
USD	1.124.000 Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	1.049.494	0,31	USD	933.000 Occidental Petroleum Corp. 8.88% 15/07/2030	988.985	0,30
EUR	1.343.000 Vodafone Group plc FRN 30/08/2084	1.355.535	0,40	EUR	966.000 Olympus Water USA 3.88% 01/10/2028	810.206	0,24
GBP	2.271.000 Zenith Finco plc 6.50% 30/06/2027	2.089.820	0,62	EUR	730.000 Spectrum Brands Inc. 4.00% 01/10/2026	704.772	0,21
	Total de Reino Unido	60.887.386	18,11		Total de Estados Unidos	21.967.204	6,52
					Total de bonos	307.457.261	91,47
					Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	307.457.261	91,47
					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente		
					Bonos		
					PAÍSES BAJOS		
EUR	1.467.000 Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 2.00% 01/09/2028	1.221.062	0,36	GBP	1.133.000 GTCR W-2 Merger Sub LLC 8.50% 15/01/2031	1.334.471	0,40
EUR	1.452.000 Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 3.00% 01/09/2029	1.106.081	0,33		Total de Países Bajos	1.334.471	0,40
EUR	1.800.000 Avantor Funding Inc. 2.63% 01/11/2025	1.724.088	0,51				
EUR	150.000 Avantor Funding Inc. 3.88% 15/07/2028	138.346	0,04				
EUR	1.833.000 Catalent Pharma Solutions Inc. 2.38% 01/03/2028	1.540.896	0,46				
EUR	942.000 Coty Inc. 5.75% 15/09/2028	950.041	0,28				
GBP	825.000 Ford Motor Credit Company LLC 2.75% 14/06/2024	920.230	0,27				
EUR	218.000 Ford Motor Credit Company LLC 3.25% 15/09/2025	210.316	0,06				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)				Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios				
Bonos (continuación)				Fondos				
REINO UNIDO				IRLANDA				
GBP	1.300.000	Market Bidco Finco plc 5.50% 04/11/2027	1.275.835	0,38	1.204.767	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	1.388.882	0,41
					161.283	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	16.210.677	4,83
					4.702	Insight Liquidity Funds plc	5.421	0,00
		Total de Reino Unido	1.275.835	0,38		Total de Irlanda	17.604.980	5,24
		Total de bonos	2.610.306	0,78		Total de fondos	17.604.980	5,24
		Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente	2.610.306	0,78		Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	17.604.980	5,24
		Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario				Valor total de las inversiones	336.773.066	100,20
		Bonos				(Coste total: 361.617.357 EUR)		
		PORTUGAL				<i>* Diferencias menores debido al redondeo.</i>		
EUR	6.900.000	Banco Espirito Santo SA 0.00% 21/01/2099**	1.173.000	0,35		<i>** Título a su valor razonable.</i>		
EUR	1.000.000	Banco Espirito Santo SA 2.63% 31/12/2049**	170.000	0,05				
EUR	1.400.000	Banco Espirito Santo SA 4.75% 15/01/2024**	238.000	0,07				
		Total de Portugal	1.581.000	0,47				
		REINO UNIDO						
EUR	644.000	BCP V Modular Services Finance II plc 6.75% 30/11/2029	468.311	0,14				
GBP	3.180.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	3.448.779	1,02				
GBP	989.000	Sherwood Financing plc 6.00% 15/11/2026	973.147	0,29				
		Total de Reino Unido	4.890.237	1,45				
		ESTADOS UNIDOS						
EUR	1.970.000	Emerald Debt Merger Sub LLC 6.38% 15/12/2030	1.965.888	0,59				
EUR	663.000	Olympus Water US Holding Corp. 9.63% 15/11/2028	663.394	0,20				
		Total de Estados Unidos	2.629.282	0,79				
		Total de bonos	9.100.519	2,71				
		Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario	9.100.519	2,71				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

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

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2023

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos				Bonos (continuación)					
BÉLGICA				ALEMANIA (continuación)					
EUR	200.000	Azelis Finance NV 5.75% 15/03/2028	200.639	0,30	EUR	400.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 11/02/2025	386.675	0,59
Total de Bélgica			200.639	0,30	EUR	300.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 16/05/2027	273.652	0,41
REPÚBLICA CHECA				FRANCIA					
EUR	300.000	Allwyn International AS 3.88% 15/02/2027	280.994	0,42	EUR	113.000	Altice France SA 2.13% 15/02/2025	106.931	0,16
Total de República Checa			280.994	0,42	EUR	113.000	Altice France SA 2.50% 15/01/2025	107.354	0,16
EUR	351.000	Altice France SA 5.88% 01/02/2027	302.637	0,45	EUR	351.000	Altice France SA 5.88% 01/02/2027	302.637	0,45
EUR	300.000	Casino Guichard Perrachon SA 3.58% 07/02/2025	4.869	0,01	EUR	300.000	Casino Guichard Perrachon SA 3.58% 07/02/2025	4.869	0,01
EUR	200.000	Crown European Holdings SA 2.88% 01/02/2026	191.252	0,29	EUR	200.000	Crown European Holdings SA 2.88% 01/02/2026	191.252	0,29
EUR	300.000	Elior Group SA 3.75% 15/07/2026	237.274	0,36	EUR	300.000	Elior Group SA 3.75% 15/07/2026	237.274	0,36
EUR	100.000	Elis SA 1.00% 03/04/2025	94.598	0,14	EUR	100.000	Elis SA 1.00% 03/04/2025	94.598	0,14
EUR	500.000	Elis SA 2.88% 15/02/2026	475.787	0,71	EUR	500.000	Elis SA 2.88% 15/02/2026	475.787	0,71
EUR	260.000	Emeria SASU 7.75% 31/03/2028	242.069	0,36	EUR	260.000	Emeria SASU 7.75% 31/03/2028	242.069	0,36
EUR	102.000	Forvia SE 2.63% 15/06/2025	98.520	0,15	EUR	102.000	Forvia SE 2.63% 15/06/2025	98.520	0,15
EUR	1.091.000	Forvia SE 2.63% 15/06/2025	1.053.778	1,58	EUR	1.091.000	Forvia SE 2.63% 15/06/2025	1.053.778	1,58
EUR	250.000	Forvia SE 2.75% 15/02/2027	225.678	0,34	EUR	250.000	Forvia SE 2.75% 15/02/2027	225.678	0,34
EUR	928.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	905.135	1,35	EUR	928.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	905.135	1,35
EUR	1.106.000	Iliad Holding SASU 5.13% 15/10/2026	1.053.942	1,57	EUR	1.106.000	Iliad Holding SASU 5.13% 15/10/2026	1.053.942	1,57
EUR	100.000	iliad SA 5.38% 14/06/2027	97.418	0,15	EUR	100.000	iliad SA 5.38% 14/06/2027	97.418	0,15
EUR	381.000	Loxam SAS 3.25% 14/01/2025	374.818	0,56	EUR	381.000	Loxam SAS 3.25% 14/01/2025	374.818	0,56
EUR	177.178	Loxam SAS 6.00% 15/04/2025	176.371	0,26	EUR	177.178	Loxam SAS 6.00% 15/04/2025	176.371	0,26
EUR	820.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	806.838	1,21	EUR	820.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	806.838	1,21
EUR	713.000	Parts Europe SA 6.50% 16/07/2025	713.232	1,07	EUR	713.000	Parts Europe SA 6.50% 16/07/2025	713.232	1,07
EUR	400.000	Valeo SE 5.38% 28/05/2027	400.429	0,60	EUR	400.000	Valeo SE 5.38% 28/05/2027	400.429	0,60
Total de Francia			7.668.930	11,48	Total de Alemania				
ALEMANIA				GIBRALTAR					
EUR	715.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.50% 11/02/2027	653.101	0,98	EUR	915.000	888 Acquisitions Limited 7.56% 15/07/2027	847.826	1,27
EUR	200.000	Deutsche Lufthansa AG 2.00% 14/07/2024	195.626	0,29	Total de Gibraltar			847.826	1,27
IRLANDA				ISLA DE MAN					
EUR	542.000	Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026			EUR	390.000	Playtech plc 4.25% 07/03/2026	378.788	0,57
EUR	146.000	Permanent TSB Group Holdings plc FRN 25/04/2028			EUR	200.000	Playtech plc 5.88% 28/06/2028	198.105	0,30
GBP	200.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III 4.88% 15/07/2028			Total de Irlanda			850.944	1,27
Total de Irlanda				Total de Isla de Man					
850.944				576.893				0,87	

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

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

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)			
ITALIA				LUXEMBURGO (continuación)			
EUR	197.000 Banca Monte dei Paschi di Siena SpA FRN 05/09/2027	195.040	0,29	GBP	637.000 B&M European Value Retail SA 3.63% 15/07/2025	711.069	1,07
EUR	553.000 FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA 5.63% 01/08/2027	511.910	0,77	EUR	800.000 Canpack SA 2.38% 01/11/2027	691.047	1,03
EUR	300.000 International Design Group SPA 6.50% 15/11/2025	291.244	0,44	EUR	100.000 Cirsa Finance International Sarl 4.75% 22/05/2025	99.218	0,15
EUR	275.000 Lottomatica SpA 7.13% 01/06/2028	281.526	0,42	EUR	207.000 Cirsa Finance International Sarl 7.88% 31/07/2028	208.423	0,31
EUR	300.000 Lottomatica SpA 9.75% 30/09/2027	323.990	0,48	EUR	200.000 Garfunkelux Holdingco 3 SA 6.75% 01/11/2025	155.100	0,23
EUR	449.000 Nexi SpA 1.63% 30/04/2026	410.535	0,61	GBP	143.000 Garfunkelux Holdingco 3 SA 7.75% 01/11/2025	125.700	0,19
EUR	500.000 Rossini Sarl 6.75% 30/10/2025	501.034	0,75	EUR	493.000 HSE Finance Sarl 5.63% 15/10/2026	255.058	0,37
EUR	250.000 Telecom Italia SpA 2.38% 12/10/2027	217.821	0,33	EUR	611.000 InPost SA 2.25% 15/07/2027	532.630	0,80
EUR	100.000 Telecom Italia SpA 2.75% 15/04/2025	95.655	0,14	EUR	147.000 LHMC Finco 2 Sarl 7.25% 02/10/2025	144.199	0,22
EUR	185.000 Telecom Italia SpA 2.88% 28/01/2026	172.559	0,26	EUR	280.000 Matterhorn Telecom SA 3.13% 15/09/2026	260.755	0,39
EUR	164.000 Telecom Italia SpA 4.00% 11/04/2024	163.063	0,24	EUR	375.000 PLT VII Finance sarl 4.63% 05/01/2026	363.844	0,54
EUR	310.000 Telecom Italia SpA 6.88% 15/02/2028	311.905	0,47	EUR	100.000 PLT VII Finance sarl 4.63% 05/01/2026	97.025	0,15
EUR	294.000 Telecom Italia SpA 7.88% 31/07/2028	304.420	0,46	EUR	222.000 Sani/Ikos Financial Holdings 1 Sarl 5.63% 15/12/2026	205.700	0,31
	Total de Italia	3.780.702	5,66		Total de Luxemburgo	4.369.697	6,54
JAPÓN				MÉXICO			
EUR	300.000 SoftBank Group Corp. 2.13% 06/07/2024	291.704	0,44	EUR	247.000 Petroleos Mexicanos 3.75% 21/02/2024	243.580	0,36
	Total de Japón	291.704	0,44		Total de México	243.580	0,36
JERSEY - ISLAS DEL CANAL				PAÍSES BAJOS			
EUR	111.642 Adient Global Holdings Limited 3.50% 15/08/2024	109.891	0,16	EUR	330.000 Ashland Services BV 2.00% 30/01/2028	280.463	0,42
EUR	570.000 Avis Budget Finance plc 4.50% 15/05/2025	561.082	0,83	EUR	350.000 Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV 3.75% 15/01/2025	345.513	0,52
EUR	481.000 Avis Budget Finance plc 4.75% 30/01/2026	471.945	0,71	EUR	610.000 Constellium NV 4.25% 15/02/2026	597.263	0,89
EUR	133.000 Kane Bidco Limited 5.00% 15/02/2027	126.201	0,19	EUR	775.000 Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	753.551	1,13
GBP	362.000 Kane Bidco Limited 6.50% 15/02/2027	382.222	0,57	EUR	327.273 Kongsberg Actuation Systems BV 5.00% 15/07/2025	315.835	0,47
	Total de Jersey - Islas del Canal	1.651.341	2,46	EUR	538.000 OI European Group BV 2.88% 15/02/2025	524.538	0,78
LUXEMBURGO				EUR	575.000 Ppf Telecom Group BV 2.13% 31/01/2025	555.330	0,83
EUR	527.000 Altice Financing SA 2.25% 15/01/2025	519.929	0,78	EUR	246.000 Q-Park Holding I BV 1.50% 01/03/2025	239.170	0,36

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

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

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*				
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)							
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)							
PAÍSES BAJOS (continuación)				ESPAÑA (continuación)							
EUR	291.979	Summer BidCo BV 9.00% 15/11/2025	284.355	0,43	EUR	600.000	Lorca Telecom Bondco SA 4.00% 18/09/2027	558.450	0,83		
EUR	1.060.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 3.75% 09/05/2027	961.343	1,44	Total de España				4.560.882	6,82	
EUR	281.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.50% 01/03/2025	276.914	0,41	SUECIA						
EUR	340.000	Trivium Packaging Finance BV 3.75% 15/08/2026	315.270	0,47	EUR	505.000	Intrum AB 4.88% 15/08/2025	460.025	0,69		
EUR	150.000	United Group BV 4.00% 15/11/2027	131.047	0,20	EUR	473.000	Verisure Holding AB 3.88% 15/07/2026	445.946	0,67		
EUR	250.000	Vz Vendor Financing II BV 2.88% 15/01/2029	193.586	0,29	EUR	100.000	Verisure Holding AB 7.13% 01/02/2028	101.222	0,15		
EUR	300.000	ZF Europe Finance BV 2.00% 23/02/2026	275.339	0,41	EUR	280.000	Verisure Holding AB 9.25% 15/10/2027	297.781	0,45		
EUR	200.000	ZF Europe Finance BV 2.50% 23/10/2027	174.979	0,26	Total de Suecia				1.304.974	1,96	
Total de Países Bajos				6.224.496	9,31	REINO UNIDO					
PANAMÁ						GBP	638.000	Bellis Acquisition Company 3.25% 16/02/2026	641.131	0,96	
EUR	100.000	Carnival Corp. 7.63% 01/03/2026	98.583	0,15	GBP	106.000	Bellis Acquisition Company plc 4.50% 16/02/2026	108.786	0,16		
Total de Panamá				98.583	0,15	GBP	306.000	Boparan Finance plc 7.63% 30/11/2025	241.562	0,36	
RUMANÍA						GBP	145.000	Co-Operative Bank Finance plc FRN 06/04/2027	153.089	0,23	
EUR	600.000	RCS & RDS SA 2.50% 05/02/2025	577.103	0,86	GBP	124.000	Co-Operative Group FRN 08/07/2026	137.191	0,21		
Total de Rumanía				577.103	0,86	GBP	145.000	Co-Operative Group Limited 5.13% 17/05/2024	165.759	0,25	
ESPAÑA						GBP	630.000	Deuce Finco plc 5.50% 15/06/2027	639.712	0,95	
EUR	400.000	Banco de Sabadell SA FRN 24/03/2026	385.008	0,58	EUR	489.000	EC Finance plc 3.00% 15/10/2026	456.226	0,68		
EUR	200.000	Banco de Sabadell SA FRN 08/09/2026	199.704	0,30	EUR	1.153.000	Ineos Finance plc 2.88% 01/05/2026	1.072.486	1,60		
EUR	600.000	Cellnex Finance Company SA 2.25% 12/04/2026	566.731	0,85	EUR	300.000	Ineos Finance plc 3.38% 31/03/2026	283.121	0,42		
EUR	300.000	Cellnex Telecom SA 2.88% 18/04/2025	293.334	0,44	EUR	482.000	Ineos Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	439.875	0,66		
EUR	545.000	Gestamp Automocion SA 3.25% 30/04/2026	524.135	0,78	EUR	394.000	Ineos Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	359.566	0,54		
EUR	1.383.000	Grifols SA 3.20% 01/05/2025	1.334.556	2,00	GBP	247.000	Inspired Entertainment Financing plc 7.88% 01/06/2026	271.825	0,41		
EUR	500.000	Grupo Antolin-Irausa SA 3.38% 30/04/2026	409.553	0,61	EUR	77.298	International Game Technology plc 3.50% 15/07/2024	76.491	0,11		
EUR	300.000	International Consolidated Airlines Group SA 2.75% 25/03/2025	289.411	0,43	EUR	980.000	International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	937.968	1,40		
					GBP	900.000	Iron Mountain UK plc 3.88% 15/11/2025	982.730	1,46		

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

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

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
REINO UNIDO (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)					
EUR	100.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 2.20% 15/01/2024	99.093	0,15	GBP	191.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.75% 14/06/2024	213.047	0,32
EUR	100.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 4.50% 15/01/2026	95.631	0,14	EUR	144.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.02% 06/03/2024	142.973	0,21
EUR	300.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 4.50% 15/07/2028	263.587	0,39	EUR	123.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.25% 15/09/2025	118.665	0,18
EUR	340.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 5.88% 15/11/2024	340.806	0,51	GBP	270.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.54% 06/03/2025	299.460	0,45
EUR	558.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 6.88% 15/11/2026	562.013	0,85	EUR	418.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.87% 03/08/2027	412.912	0,62
GBP	543.000	Jerrold Finco plc 4.88% 15/01/2026	588.094	0,88	EUR	464.000	IQVIA Inc. 1.75% 15/03/2026	432.392	0,65
GBP	200.000	Marks & Spencer plc 3.75% 19/05/2026	216.381	0,32	EUR	750.000	IQVIA Inc. 2.88% 15/09/2025	726.871	1,09
EUR	404.000	Pinnacle Bidco plc 5.50% 15/02/2025	409.069	0,61	USD	260.000	Occidental Petroleum Corp. 5.88% 01/09/2025	244.721	0,37
GBP	100.000	Pinnacle Bidco plc 6.38% 15/02/2025	115.200	0,17	EUR	1.034.000	Silgan Holdings Inc. 3.25% 15/03/2025	1.007.691	1,51
EUR	246.000	Pinnacle Bidco plc 8.25% 11/10/2028	245.579	0,37	EUR	400.000	Spectrum Brands Inc. 4.00% 01/10/2026	386.176	0,58
GBP	115.000	Pinnacle Bidco plc 10.00% 11/10/2028	132.532	0,20	Total de Estados Unidos		5.710.949	8,56	
GBP	400.000	Premier Foods Finance plc 3.50% 15/10/2026	421.710	0,63	Total de bonos		60.027.758	89,83	
EUR	238.000	Rolls-Royce plc 0.88% 09/05/2024	232.301	0,35	Bonos - convertibles				
GBP	463.000	Rolls-Royce plc 3.38% 18/06/2026	489.205	0,73	FRANCIA				
GBP	120.000	Rolls-Royce plc 5.75% 15/10/2027	131.711	0,20	EUR	10.988	Elis SA 0.00% 06/10/2023	349.964	0,52
EUR	482.000	Sherwood Financing plc 4.50% 15/11/2026	423.157	0,63	Total de Francia		349.964	0,52	
EUR	530.000	Synthomer plc 3.88% 01/07/2025	507.234	0,76	Total de bonos - convertibles		349.964	0,52	
EUR	805.000	Victoria plc 3.63% 26/08/2026	638.003	0,95	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa		60.377.722	90,35	
GBP	600.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.00% 15/04/2027	643.247	0,96	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				
GBP	362.000	Zenith Finco plc 6.50% 30/06/2027	333.120	0,50	Bonos				
Total de Reino Unido		13.855.191	20,70	REINO UNIDO					
ESTADOS UNIDOS				GBP	200.000	Market Bidco Finco plc 5.50% 04/11/2027	196.282	0,29	
EUR	857.000	Avantor Funding Inc. 2.63% 01/11/2025	820.858	1,23	Total de Reino Unido		196.282	0,29	
EUR	290.000	Ball Corp. 0.88% 15/03/2024	285.093	0,43	Total de bonos		196.282	0,29	
EUR	344.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 2.38% 01/03/2028	289.181	0,43	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente		196.282	0,29	
EUR	141.000	Coty Inc. 5.75% 15/09/2028	142.204	0,21					
EUR	200.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.33% 25/11/2025	188.705	0,28					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

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

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario			
Bonos			
REINO UNIDO			
GBP	1.205.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	1.306.848 1,95
GBP	178.000	Sherwood Financing plc 6.00% 15/11/2026	175.147 0,26
GBP	167.000	Talktalk Telecom Group plc 3.88% 20/02/2025	146.165 0,22
		Total de Reino Unido	1.628.160 2,43
ESTADOS UNIDOS			
EUR	180.000	Olympus Water US Holding Corp. 9.63% 15/11/2028	180.107 0,27
		Total de Estados Unidos	180.107 0,27
		Total de bonos	1.808.267 2,70
		Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario	1.808.267 2,70
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
	5.244	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	527.112 0,79
		Total de Irlanda	527.112 0,79
		Total de fondos	527.112 0,79
		Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	527.112 0,79
		Valor total de las inversiones	62.909.383 94,13
		(Coste total: 65.583.548 EUR)	

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2023

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos				Bonos (continuación)					
AUSTRIA				FRANCIA (continuación)					
EUR	400.000	Erste Group Bank AG 0.13% 17/05/2028	334.568	0,08	EUR	1.100.000	Credit Agricole SA 0.13% 09/12/2027	930.835	0,23
EUR	100.000	Erste Group Bank AG 0.13% 17/05/2028	83.642	0,02	EUR	2.000.000	Credit Agricole SA FRN 21/09/2029	1.644.925	0,40
EUR	2.600.000	Erste Group Bank AG FRN 16/01/2031	2.537.921	0,62	GBP	2.300.000	Credit Agricole SA 4.88% 23/10/2029	2.525.537	0,62
EUR	2.200.000	Telekom Finanzmanagement GmbH 1.50% 07/12/2026	2.067.945	0,51	EUR	2.000.000	Credit Agricole SA FRN 28/08/2033	1.990.436	0,49
		Total de Austria	5.024.076	1,23	EUR	2.600.000	Credit Mutuel Arkea SA 0.38% 03/10/2028	2.163.138	0,53
BÉLGICA				EUR 4.300.000 Danone SA 1.00% 26/03/2025				4.120.617	1,01
EUR	700.000	Bpost SA 1.25% 11/07/2026	646.629	0,16	EUR	300.000	Electricite de France SA 1.00% 29/11/2033	215.250	0,05
EUR	4.100.000	KBC Group NV 4.38% 06/12/2031	4.017.415	0,99	EUR	700.000	Electricite de France SA 1.00% 29/11/2033	502.250	0,12
EUR	900.000	VGP NV 1.63% 17/01/2027	764.454	0,19	EUR	1.200.000	Forvia SE 2.38% 15/06/2029	979.912	0,24
		Total de Bélgica	5.428.498	1,34	EUR	675.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	658.369	0,16
DINAMARCA				EUR 800.000 Ile-de-France Mobilites 0.40% 28/05/2031				631.600	0,16
EUR	1.971.000	Danske Bank A/S FRN 10/01/2031	1.939.163	0,48	EUR	3.400.000	La Banque Postale SA 0.75% 23/06/2031	2.585.291	0,64
EUR	550.000	Nykredit Realkredit AS 0.38% 17/01/2028	461.295	0,11	EUR	800.000	La Poste SA 1.38% 21/04/2032	646.939	0,16
		Total de Dinamarca	2.400.458	0,59	EUR	3.700.000	Orange SA 0.13% 16/09/2029	2.991.313	0,73
FINLANDIA				EUR 1.800.000 Orange SA 0.13% 16/09/2029				1.455.234	0,36
GBP	1.064.000	Nordea Bank Abp FRN 02/06/2026	1.226.858	0,30	EUR	3.400.000	Orange SA 2.38% 18/05/2032	3.016.261	0,73
EUR	2.100.000	OP Corporate Bank plc 0.63% 27/07/2027	1.831.833	0,45	EUR	1.200.000	Orange SA 3.88% 11/09/2035	1.164.275	0,29
		Total de Finlandia	3.058.691	0,75	EUR	1.900.000	Praemia Healthcare SACA 5.50% 19/09/2028	1.893.020	0,47
FRANCIA				EUR 800.000 Regie Autonome des Transports Parisiens 0.88% 25/05/2027				727.780	0,18
EUR	3.760.000	AXA SA FRN 07/10/2041	2.859.594	0,71	EUR	1.100.000	RTE Réseau de Transport d'Electricite SADIR 0.75% 12/01/2034	813.671	0,20
EUR	4.100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 4.00% 21/11/2029	4.043.151	0,99	EUR	700.000	RTE Réseau de Transport d'Electricite SADIR 1.88% 23/10/2037	530.807	0,13
EUR	1.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 4.13% 18/09/2030	988.104	0,24	EUR	2.800.000	Sanofi 1.50% 01/04/2030	2.476.361	0,61
EUR	1.000.000	BNP Paribas SA FRN 14/10/2027	885.740	0,22	EUR	1.600.000	Schneider Electric SE 1.84% 13/10/2025	1.538.278	0,38
EUR	2.200.000	BPCE SA 4.13% 10/07/2028	2.188.057	0,54	EUR	200.000	SNCF Réseau 2.25% 20/12/2047	139.776	0,03
EUR	2.400.000	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0.00% 25/11/2026	2.157.576	0,53	EUR	1.100.000	Societe du Grand Paris EPIC 1.63% 08/04/2042	741.658	0,18
EUR	1.500.000	Caisse des Depots et Consignations 0.01% 15/09/2025	1.397.531	0,34	EUR	900.000	Societe Generale SA FRN 02/12/2027	790.891	0,19
EUR	2.500.000	Caisse des Depots et Consignations 0.01% 01/06/2026	2.277.702	0,56	EUR	2.500.000	Societe Generale SA FRN 02/12/2027	2.196.919	0,54
EUR	2.600.000	CNP Assurances FRN 18/07/2053	2.455.961	0,60	EUR	6.700.000	Suez SACA 4.63% 03/11/2028	6.790.896	1,67

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
FRANCIA (continuación)				ALEMANIA (continuación)					
EUR	1.500.000	Unedic Asseo 0.25% 25/11/2029	1.243.185	0,31	EUR	2.900.000	Vonovia SE 1.88% 28/06/2028	2.532.357	0,61
					EUR	1.100.000	Vonovia SE 4.75% 23/05/2027	1.093.680	0,26
		Total de Francia	67.358.840	16,54			Total de Alemania	40.158.800	9,86
ALEMANIA				IRLANDA					
EUR	5.100.000	Amprion GmbH 3.97% 22/09/2032	4.971.736	1,23	EUR	2.620.000	AIB Group plc FRN 04/04/2028	2.400.644	0,59
EUR	2.700.000	Amprion GmbH 4.13% 07/09/2034	2.624.821	0,64	EUR	6.484.000	AIB Group plc FRN 23/07/2029	6.390.472	1,56
EUR	900.000	Bayerische Landesbode 0.25% 21/03/2036	598.176	0,15	EUR	3.183.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	2.830.135	0,70
EUR	1.100.000	Bayerische Landesbodenkreditanstalt 0.63% 22/11/2027	984.480	0,24	EUR	750.000	Bank of Ireland Group plc FRN 16/07/2028	754.934	0,19
EUR	1.100.000	Commerzbank AG FRN 24/03/2026	1.036.618	0,25	EUR	2.800.000	Bank of Ireland Group plc FRN 04/07/2031	2.798.874	0,69
EUR	900.000	Commerzbank AG FRN 25/03/2029	898.319	0,22	EUR	1.250.000	Kerry Group Financial Services 0.88% 01/12/2031	974.114	0,24
EUR	1.500.000	Deutsche Bahn Finance GmbH 0.35% 29/09/2031	1.169.148	0,29	EUR	800.000	Lunar Funding V for Swisscom AG 1.13% 12/10/2026	738.553	0,18
EUR	600.000	Deutsche Bahn Finance GmbH 0.63% 08/12/2050	267.707	0,07			Total de Irlanda	16.887.726	4,15
EUR	1.050.000	Deutsche Bank AG FRN 10/06/2026	999.184	0,25	ITALIA				
USD	1.340.000	Deutsche Bank AG 1.69% 19/03/2026	1.144.418	0,28	EUR	700.000	Aeroporti di Roma SpA 1.75% 30/07/2031	559.152	0,14
EUR	600.000	Deutsche Kreditbank AG 0.88% 02/10/2028	529.666	0,13	EUR	700.000	Aeroporti di Roma SpA 1.75% 30/07/2031	559.152	0,14
EUR	1.700.000	E.ON SE 0.35% 28/02/2030	1.357.751	0,33	EUR	2.050.000	Assicurazioni Generali SpA 1.71% 30/06/2032	1.542.458	0,38
EUR	1.985.000	E.ON SE 0.60% 01/10/2032	1.475.957	0,36	EUR	400.000	Banco BPM SpA 0.88% 15/07/2026	361.811	0,09
EUR	915.000	E.ON SE 0.60% 01/10/2032	680.353	0,17	EUR	1.200.000	Ferrovie dello Stato Italiane SpA 1.13% 09/07/2026	1.106.661	0,27
EUR	2.000.000	E.ON SE 1.63% 29/03/2031	1.693.316	0,42	EUR	1.300.000	Ferrovie dello Stato Italiane SpA 1.50% 27/06/2025	1.242.967	0,31
EUR	6.600.000	Eurogrid GmbH 1.11% 15/05/2032	5.145.184	1,27	EUR	450.000	Intesa Sanpaolo SpA 5.25% 13/01/2030	454.191	0,11
EUR	300.000	Hamburger Hochbahn AG 0.13% 24/02/2031	232.799	0,06	GBP	3.017.000	Intesa Sanpaolo SpA 6.63% 31/05/2033	3.373.824	0,83
EUR	600.000	Hamburger Hochbahn AG 0.13% 24/02/2031	465.597	0,11	EUR	1.800.000	Snam SpA 0.00% 07/12/2028	1.457.756	0,36
EUR	2.800.000	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG FRN 26/05/2041	2.125.063	0,52	EUR	1.800.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale 0.38% 23/06/2029	1.468.865	0,36
EUR	1.610.000	NRW Bank 0.10% 09/07/2035	1.079.205	0,27	EUR	1.200.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale 3.88% 24/07/2033	1.156.419	0,28
EUR	2.900.000	O2 Telefonica Deutschland Finanzierungs GmbH 1.75% 05/07/2025	2.769.695	0,68	EUR	400.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale - Perp FRN	345.701	0,08
EUR	1.900.000	O2 Telefonica Deutschland Finanzierungs GmbH 1.75% 05/07/2025	1.814.628	0,45	EUR	200.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale - Perp FRN	172.851	0,04
EUR	4.500.000	Vonovia SE 1.50% 14/06/2041	2.468.942	0,60			Total de Italia	13.801.808	3,39

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
ESPAÑA (continuación)				REINO UNIDO (continuación)					
EUR	1.000.000	CaixaBank SA FRN 26/05/2028	866.612	0,21	EUR	1.444.000	NatWest Group plc FRN 14/03/2028	1.439.161	0,35
EUR	1.700.000	Iberdrola Finanzas SA 1.38% 11/03/2032	1.412.047	0,35	GBP	1.800.000	Pearson Funding plc 3.75% 04/06/2030	1.798.079	0,44
EUR	1.600.000	Telefonica Emisiones SA 2.59% 25/05/2031	1.449.610	0,36	GBP	270.000	Platform HG Financing plc 1.93% 15/09/2041	184.649	0,05
		Total de España	10.102.254	2,49	GBP	400.000	RCB Bonds plc 3.50% 08/12/2031	363.771	0,09
SUECIA				REINO UNIDO (continuación)					
EUR	1.960.000	Essity AB 1.13% 27/03/2024	1.931.825	0,47	GBP	500.000	Severn Trent Utilities Finance plc 2.00% 02/06/2040	329.860	0,08
		Total de Suecia	1.931.825	0,47	GBP	200.000	Stonewater Funding plc 1.63% 10/09/2036	146.226	0,04
REINO UNIDO				REINO UNIDO (continuación)					
GBP	250.000	Aster Treasury plc 1.41% 27/01/2036	184.557	0,05	EUR	5.130.000	Thames Water Utilities Finance plc 4.38% 18/01/2031	4.556.102	1,12
EUR	3.350.000	AstraZeneca plc 0.38% 03/06/2029	2.777.632	0,68	GBP	200.000	University College London 1.63% 04/06/2061	100.555	0,02
GBP	800.000	BUPA Finance plc 5.00% 08/12/2026	884.054	0,21	GBP	300.000	University of Southampton 2.25% 11/04/2057	176.323	0,04
GBP	1.139.000	BUPA Finance plc - Perp FRN	804.338	0,20	USD	739.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	690.015	0,17
GBP	740.000	Cadent Finance plc 5.75% 14/03/2034	821.135	0,20	GBP	1.300.000	Vodafone Group plc FRN 30/08/2086	1.488.665	0,37
GBP	200.000	Cardiff University 3.00% 07/12/2055	145.512	0,04	EUR	10.670.000	WellCome Trust Limited 1.13% 21/01/2027	9.792.882	2,40
GBP	810.000	Co-Operative Bank Finance plc FRN 06/04/2027	855.189	0,21	EUR	1.820.000	Yorkshire Building Society 0.01% 16/11/2028	1.500.912	0,37
GBP	1.002.000	Co-Operative Bank Finance plc FRN 24/05/2028	1.145.277	0,28	GBP	2.300.000	Yorkshire Building Society FRN 11/10/2030	2.223.380	0,54
GBP	630.000	DS Smith plc 2.88% 26/07/2029	613.728	0,15	GBP	1.477.000	Yorkshire Building Society FRN 15/11/2028	1.664.395	0,41
EUR	2.624.000	DS Smith plc 4.50% 27/07/2030	2.570.731	0,63			Total de Reino Unido	58.729.506	14,41
GBP	400.000	DWR Cymru Financing UK plc 2.38% 31/03/2034	314.071	0,08	ESTADOS UNIDOS				
GBP	300.000	Legal & General Group plc FRN 27/10/2045	336.032	0,08	EUR	292.000	Air Products and Chemicals Inc. 4.00% 03/03/2035	284.321	0,07
EUR	3.800.000	Motability Operations Group plc 0.13% 20/07/2028	3.169.048	0,78	USD	2.600.000	Roche Holdings Inc. 2.38% 28/01/2027	2.239.660	0,56
EUR	2.865.000	Motability Operations Group plc 0.13% 20/07/2028	2.389.296	0,59			Total de Estados Unidos	2.523.981	0,63
EUR	4.200.000	Motability Operations Group plc 3.50% 17/07/2031	4.006.226	0,98	Total de bonos			286.964.301	70,49
EUR	1.848.000	National Grid Electricity Distribution East Midlands plc 3.95% 20/09/2032	1.760.689	0,43	Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				
EUR	1.167.000	National Grid plc 3.88% 16/01/2029	1.138.118	0,28	AUSTRIA				
GBP	1.779.000	Nationwide Building Society 6.13% 21/08/2028	2.076.272	0,51	EUR	700.000	Oesterreichische Kontrollbank AG 0.00% 08/10/2026	630.799	0,15
EUR	7.800.000	Natwest Group plc FRN 26/02/2030	6.282.626	1,54			Total de Austria	630.799	0,15

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)				Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)					
ITALIA				ESPAÑA (continuación)					
EUR	800.000	Cassa Depositi e Prestiti SpA 1.00% 11/02/2030	638.538	0,16	EUR	700.000	Autonomous Community of Madrid 1.57% 30/04/2029	623.542	0,15
EUR	700.000	Cassa Depositi e Prestiti SpA 2.00% 20/04/2027	646.319	0,16	EUR	3.200.000	Autonomous Community of Madrid 1.72% 30/04/2032	2.675.353	0,65
EUR	800.000	Cassa Depositi e Prestiti SpA 2.13% 21/03/2026	760.319	0,19	EUR	300.000	Basque (Govt) 1.88% 30/07/2033	247.184	0,06
EUR	250.000	Italy (Govt of) 1.50% 30/04/2045	136.833	0,03	EUR	1.500.000	Instituto de Credito Oficial 0.00% 30/04/2025	1.414.422	0,35
		Total de Italia	2.182.009	0,54	EUR	200.000	Instituto de Credito Oficial 0.00% 30/04/2025	188.590	0,05
					EUR	700.000	Instituto de Credito Oficial 0.25% 30/04/2024	684.964	0,17
JAPÓN					EUR	1.810.000	Instituto de Credito Oficial 0.75% 31/10/2023	1.805.255	0,44
USD	1.850.000	Japan International Cooperation Agency 4.00% 23/05/2028	1.669.586	0,41	EUR	25.000	Spain (Govt of) 1.00% 30/07/2042	14.437	0,00
		Total de Japón	1.669.586	0,41	EUR	400.000	Xunta de Galicia 0.08% 30/07/2027	348.684	0,09
LUXEMBURGO							Total de España	11.863.103	2,92
EUR	775.000	Luxembourg (Govt of) 0.00% 14/09/2032	579.529	0,14	SUPRANACIONAL				
		Total de Luxemburgo	579.529	0,14	CAD	300.000	Asian Development Bank 1.50% 04/05/2028	182.631	0,04
PAÍSES BAJOS					CAD	800.000	Asian Development Bank 1.63% 28/01/2025	533.242	0,13
EUR	1.800.000	BNG Bank NV 3.00% 11/01/2033	1.731.456	0,43	GBP	2.200.000	Asian Development Bank FRN 23/05/2029	2.626.510	0,65
EUR	600.000	Nederlandse Waterschapsbank NV 0.13% 03/09/2035	400.820	0,10	USD	200.000	Central American Bank for Economic Integration 5.00% 09/02/2026	185.912	0,05
EUR	1.800.000	Nederlandse Waterschapsbank NV 1.50% 15/06/2039	1.331.352	0,32	EUR	1.450.000	Council of Europe 0.38% 27/03/2025	1.379.550	0,34
EUR	1.900.000	Nederlandse Waterschapsbank NV 2.75% 17/12/2029	1.830.228	0,45	EUR	1.000.000	Council of Europe Development Bank 0.00% 10/04/2026	916.621	0,23
EUR	500.000	Netherlands (Govt of) 0.50% 15/01/2040	326.705	0,08	EUR	4.000.000	Council of Europe Development Bank 0.00% 09/04/2027	3.556.352	0,88
		Total de Países Bajos	5.620.561	1,38	EUR	5.000.000	Council of Europe Development Bank 1.00% 13/04/2029	4.419.005	1,08
REPÚBLICA DE COREA (SUR)					EUR	2.000.000	European Investment Bank 0.00% 15/05/2028	1.722.245	0,42
USD	571.000	Export-Import Bank of Korea 5.13% 11/01/2033	529.435	0,13	GBP	3.300.000	European Investment Bank 0.88% 15/05/2026	3.430.969	0,84
		Total de República de Corea (Sur)	529.435	0,13	GBP	975.000	European Investment Bank 0.88% 15/05/2026	1.013.695	0,25
ESPAÑA					EUR	800.000	European Union 0.00% 04/03/2026	739.966	0,18
EUR	1.400.000	Autonomous Community of Andalusia 0.50% 30/04/2031	1.081.339	0,27	EUR	4.190.000	European Union 0.00% 04/07/2035	2.772.608	0,68
EUR	1.000.000	Autonomous Community of Andalusia 2.40% 30/04/2032	876.895	0,22					
EUR	2.370.000	Autonomous Community of Madrid 0.42% 30/04/2030	1.902.438	0,47					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)						
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)				Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)						
SUPRANACIONAL (continuación)				REINO UNIDO (continuación)						
EUR	700.000	European Union 0.00% 04/07/2035	463.204	0,11	GBP	5.000	United Kingdom Gilt 0.88% 31/07/2033	4.144	0,00	
EUR	1.700.000	European Union 0.10% 04/10/2040	938.865	0,23	Total de Reino Unido			4.062.699	1,00	
EUR	5.740.000	European Union 0.30% 04/11/2050	2.472.182	0,61	Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				114.657.105	28,17
EUR	1.500.000	European Union 0.75% 04/01/2047	824.568	0,20	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				401.621.406	98,66
GBP	1.600.000	Inter-American Development Bank 4.13% 28/04/2028	1.797.632	0,44	Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios					
EUR	500.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.01% 24/04/2028	430.228	0,11	Fondos					
EUR	399.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.20% 21/01/2061	121.267	0,03	IRLANDA					
EUR	300.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.70% 22/10/2046	161.769	0,04	6.747	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier		678.141	0,17	
EUR	100.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.70% 22/10/2046	53.923	0,01	Total de Irlanda			678.141	0,17	
USD	2.790.000	International Finance Facility for Immunisation Company 0.38% 06/11/2023	2.622.675	0,64	Total de fondos				678.141	0,17
USD	1.950.000	International Finance Facility for Immunisation Company 1.00% 21/04/2026	1.661.411	0,41	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios				678.141	0,17
SEK	3.000.000	Nordic Investment Bank 0.10% 13/10/2025	241.872	0,06	Valor total de las inversiones				402.299.547	98,83
EUR	1.100.000	Nordic Investment Bank 2.50% 30/01/2030	1.050.135	0,26	(Coste total: 449.304.530 EUR)					
Total de supranacional			36.319.037	8,92	<i>*Diferencias menores debido al redondeo.</i>					
SUECIA										
SEK	3.000.000	Sweden (Govt of) 0.13% 09/09/2030	215.285	0,05	Total de Suecia				215.285	0,05
REINO UNIDO										
GBP	3.680.000	International Finance Facility for Immunisation Company 2.75% 07/06/2025	4.058.555	1,00						

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
SINGAPUR				REINO UNIDO (continuación)					
USD	339.000	Pfizer Investment Enterprises Pte Limited 4.75% 19/05/2033	303.357	0,24	EUR	220.000	Anglo American Capital plc 5.00% 15/03/2031	220.150	0,17
		Total de Singapur	303.357	0,24	GBP	352.000	Arqiva Financing plc 7.21% 30/06/2028	417.298	0,33
ESPAÑA				EUR 300.000 BCP V Modular Services Finance II plc 4.75% 30/11/2028				251.554	0,20
EUR	200.000	Banco de Sabadell SA FRN 07/06/2029	199.532	0,16	GBP	254.000	Bellis Acquisition Company 3.25% 16/02/2026	255.246	0,20
EUR	300.000	Cellnex Finance Company SA 0.75% 15/11/2026	266.649	0,21	GBP	230.000	Bellis Acquisition Company plc 4.50% 16/02/2026	236.044	0,18
EUR	200.000	Cellnex Telecom SA 1.88% 26/06/2029	170.050	0,13	GBP	345.000	Boparan Finance plc 7.63% 30/11/2025	272.349	0,21
EUR	823.000	Grifols SA 3.20% 01/05/2025	794.172	0,62	EUR	1.113.000	BP Capital Markets plc - Perp FRN	1.042.058	0,81
EUR	155.000	Kaixo Bondco Telecom SA 5.13% 30/09/2029	136.745	0,11	EUR	636.000	British American Tobacco plc - Perp FRN	546.254	0,43
EUR	553.000	Lorca Telecom Bondco SA 4.00% 18/09/2027	514.705	0,40	EUR	825.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	648.736	0,50
EUR	298.000	Nortegas Energia Distribucion SAU 2.07% 28/09/2027	270.525	0,21	GBP	548.000	Co-Operative Bank Finance plc FRN 06/04/2027	578.572	0,45
		Total de España	2.352.378	1,84	GBP	509.000	Deuce Finco plc 5.50% 15/06/2027	516.846	0,41
SUECIA				EUR 413.000 DS Smith plc 4.38% 27/07/2027				412.160	0,32
EUR	345.000	Heimstaden Bostad AB - Perp FRN	152.316	0,12	EUR	616.000	DS Smith plc 4.50% 27/07/2030	603.495	0,47
EUR	660.000	Heimstaden Bostad AB - Perp FRN	321.173	0,25	EUR	632.000	EC Finance plc 3.00% 15/10/2026	589.640	0,45
EUR	921.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	799.614	0,62	EUR	1.074.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	1.052.111	0,81
EUR	194.000	Verisure Holding AB 3.25% 15/02/2027	174.767	0,14	USD	728.000	HSBC Holdings plc FRN 11/08/2033	634.109	0,49
EUR	115.000	Verisure Holding AB 7.13% 01/02/2028	116.406	0,09	GBP	374.000	HSBC Holdings plc FRN 14/09/2031	435.070	0,34
EUR	321.000	Verisure Midholding A 5.25% 15/02/2029	282.428	0,22	EUR	158.000	Ineos Finance plc 2.13% 15/11/2025	149.827	0,12
		Total de Suecia	1.846.704	1,44	EUR	331.000	Ineos Finance plc 3.38% 31/03/2026	312.377	0,24
SUIZA				EUR 61.000 Ineos Finance plc 3.38% 31/03/2026				57.568	0,04
EUR	857.000	Credit Suisse AG 0.25% 01/09/2028	704.397	0,54	EUR	192.000	Ineos Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	175.220	0,14
EUR	803.000	UBS Group AG 0.63% 18/01/2033	547.762	0,43	EUR	130.000	Ineos Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	118.638	0,09
		Total de Suiza	1.252.159	0,97	GBP	304.000	Inspired Entertainment Financing plc 7.88% 01/06/2026	334.554	0,26
REINO UNIDO				GBP 315.000 Iron Mountain UK plc 3.88% 15/11/2025				343.956	0,27
GBP	500.000	Anglian Water Osprey Financing plc 2.00% 31/07/2028	439.603	0,34	EUR	422.000	Lloyds Bank Corporate Markets 4.13% 30/05/2027	419.631	0,33
EUR	318.000	Anglo American Capital plc 4.75% 21/09/2032	310.461	0,24	GBP	175.000	Marks & Spencer plc 3.75% 19/05/2026	189.333	0,15

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
REINO UNIDO (continuación)				REINO UNIDO (continuación)					
GBP	368.167	Mitchells & Butlers Finance plc 6.01% 15/12/2028	392.877	0,31	GBP	752.000	Zenith Finco plc 6.50% 30/06/2027	692.006	0,54
EUR	483.000	National Grid Electricity Distribution East Midlands plc 3.95% 20/09/2032	460.180	0,36	Total de Reino Unido				
EUR	600.000	Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	493.929	0,39	ESTADOS UNIDOS				
EUR	602.000	NatWest Group plc FRN 14/09/2032	499.857	0,39	USD	209.000	Amgen Inc. 4.20% 22/02/2052	148.243	0,12
EUR	456.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	393.077	0,31	USD	560.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2030	516.953	0,40
EUR	244.000	Pinnacle Bidco plc 5.50% 15/02/2025	247.061	0,19	USD	901.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2033	814.584	0,63
GBP	297.000	Pinnacle Bidco plc 6.38% 15/02/2025	342.145	0,27	USD	295.000	Amgen Inc. 5.75% 02/03/2063	257.559	0,20
EUR	379.000	Pinnacle Bidco plc 8.25% 11/10/2028	378.352	0,29	EUR	660.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 2.00% 01/09/2028	549.353	0,43
GBP	176.000	Pinnacle Bidco plc 10.00% 11/10/2028	202.832	0,16	EUR	190.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 3.00% 01/09/2029	144.735	0,11
GBP	700.000	Rolls-Royce plc 5.75% 15/10/2027	768.315	0,60	EUR	713.000	Bank of America Corp. FRN 22/03/2031	558.933	0,44
GBP	165.000	Santander UK plc - Perp 10.06%	251.843	0,20	EUR	540.000	Bank of America Corp. FRN 22/03/2031	423.315	0,33
EUR	291.000	Sherwood Financing plc 4.50% 15/11/2026	255.475	0,20	EUR	521.000	Bank of America Corp. FRN 24/05/2032	404.247	0,32
EUR	340.000	Synthomer plc 3.88% 01/07/2025	325.395	0,25	EUR	889.000	Berkshire Hathaway Finance Corp. 1.50% 18/03/2030	762.631	0,60
GBP	620.000	Thames Water Kemble Finance plc 4.63% 19/05/2026	443.049	0,35	EUR	243.000	Boeing Company 5.93% 01/05/2060	206.315	0,16
EUR	800.000	Thames Water Utilities Finance plc 0.88% 31/01/2028	657.510	0,51	EUR	485.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 2.38% 01/03/2028	407.711	0,32
EUR	660.000	Thames Water Utilities Finance plc 4.38% 18/01/2031	586.165	0,46	USD	118.000	Goodman USA Finance Three 3.70% 15/03/2028	100.097	0,08
EUR	489.000	Victoria plc 3.63% 26/08/2026	387.557	0,30	EUR	428.000	Honeywell International Inc. 4.13% 02/11/2034	420.438	0,33
GBP	221.000	Virgin Media Secured Finance plc 4.25% 15/01/2030	204.890	0,16	USD	560.000	JPMorgan Chase & Company FRN 08/11/2032	410.749	0,32
GBP	400.000	Virgin Money UK plc FRN 24/04/2026	433.122	0,34	USD	1.627.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2032	1.213.248	0,94
EUR	317.000	Virgin Money UK plc FRN 29/10/2028	305.660	0,24	EUR	576.000	Metropolitan Life Global Funding I 3.75% 05/12/2030	557.167	0,43
GBP	230.000	Virgin Money UK plc FRN 23/08/2029	269.381	0,21	EUR	388.000	Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	368.778	0,29
GBP	429.000	Vmed O2 UK Financing 4.00% 31/01/2029	405.507	0,31	EUR	951.000	Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	924.194	0,72
EUR	432.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	399.086	0,31	EUR	1.212.000	New York Life Global Funding 3.63% 09/01/2030	1.181.203	0,93
USD	450.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	420.171	0,33	EUR	638.000	Northwestern Mutual Global Funding 4.11% 15/03/2030	633.751	0,49
EUR	700.000	Vodafone Group plc FRN 30/08/2084	706.534	0,55	USD	220.000	Occidental Petroleum Corp. 6.63% 01/09/2030	210.405	0,16
					USD	265.000	Occidental Petroleum Corp. 8.88% 15/07/2030	280.901	0,22
					EUR	513.000	Olympus Water USA 3.88% 01/10/2028	430.265	0,34

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)					
ESTADOS UNIDOS (continuación)				REINO UNIDO					
GBP	350.000	Time Warner Cable Inc. 5.75% 02/06/2031	377.036	0,29	GBP	575.000	United Kingdom Gilt 4.13% 29/01/2027	653.330	0,50
USD	980.000	Warnermedia Holdings Inc. 5.14% 15/03/2052	688.862	0,54			Total de Reino Unido	653.330	0,50
		Total de Estados Unidos	12.991.673	10,14			Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda	6.934.289	5,41
		Total de bonos	104.392.032	81,37			Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	111.326.321	86,78
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente					
EGIPTO				Bonos					
EUR	450.000	Egypt (Govt of) 5.63% 16/04/2030	251.799	0,20					
		Total de Egipto	251.799	0,20			AUSTRALIA		
ALEMANIA				AUSTRALIA					
EUR	2.000.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.00% 30/09/2026	1.809.442	1,41	USD	514.000	NBN Company Limited 5.75% 06/10/2028	487.857	0,38
EUR	1.300.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2.88% 29/05/2026	1.281.022	1,00	USD	1.270.000	Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	1.108.909	0,87
		Total de Alemania	3.090.464	2,41			Total de Australia	1.596.766	1,25
HUNGRÍA				BÉLGICA					
EUR	358.000	Hungary (Govt of) 5.38% 12/09/2033	345.285	0,27	USD	600.000	KBC Group NV FRN 21/09/2034	550.754	0,43
		Total de Hungría	345.285	0,27			Total de Bélgica	550.754	0,43
COSTA DE MARFIL				BERMUDAS					
EUR	290.000	Ivory Coast (Govt of) 5.88% 17/10/2031	239.527	0,19	USD	833.000	Bacardi Limited 4.45% 15/05/2025	763.446	0,60
		Total de Costa de Marfil	239.527	0,19			Total de Bermudas	763.446	0,60
RUMANÍA				DINAMARCA					
EUR	550.000	Romania (Govt of) 2.00% 28/01/2032	397.471	0,31	USD	811.000	Danske Bank A/S 1.55% 10/09/2027	670.840	0,52
		Total de Rumanía	397.471	0,31			Total de Dinamarca	670.840	0,52
SUPRANACIONAL				FRANCIA					
EUR	750.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.00% 15/01/2027	672.210	0,52	USD	600.000	BPCE SA 2.70% 01/10/2029	476.522	0,37
GBP	1.100.000	International Finance Corp. 5.50% 22/07/2026	1.284.203	1,01	USD	250.000	Credit Agricole SA 5.51% 05/07/2033	227.322	0,18
		Total de supranacional	1.956.413	1,53			Total de Francia	703.844	0,55

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)				Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario (continuación)						
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)						
IRLANDA				ESTADOS UNIDOS						
USD	256.000	AIB Group plc FRN 13/09/2029	241.232	0,19	EUR	564.000	Emerald Debt Merger Sub LLC 6.38% 15/12/2030	562.823	0,44	
Total de Irlanda			241.232	0,19	Total de Estados Unidos			562.823	0,44	
ITALIA				Total de bonos				2.157.405	1,69	
USD	560.000	Intesa Sanpaolo SpA 6.63% 20/06/2033	498.496	0,39	Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario				2.157.405	1,69
Total de Italia			498.496	0,39	Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios					
PAÍSES BAJOS				Fondos						
GBP	317.000	GTCR W-2 Merger Sub LLC 8.50% 15/01/2031	373.369	0,29	IRLANDA					
USD	467.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	441.086	0,34	28.621	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier		2.876.738	2,24	
Total de Países Bajos			814.455	0,63	Total de Irlanda			2.876.738	2,24	
ESTADOS UNIDOS				Total de fondos				2.876.738	2,24	
USD	52.000	Occidental Petroleum Corp. 7.88% 15/09/2031	53.295	0,04	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios				2.876.738	2,24
Total de Estados Unidos			53.295	0,04	Valor total de las inversiones				122.253.592	95,31
Total de bonos			5.893.128	4,60	(Coste total: 135.281.891 EUR)					
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente			5.893.128	4,60	<i>* Diferencias menores debido al redondeo.</i>					
				<i>** Título a su valor razonable.</i>						
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario										
Bonos										
PORTUGAL										
EUR	100.000	Banco Espirito Santo SA 0.00% 21/01/2099**	17.000	0,01						
Total de Portugal			17.000	0,01						
REINO UNIDO										
EUR	451.000	BCP V Modular Services Finance II plc 6.75% 30/11/2029	327.963	0,26						
GBP	812.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	880.631	0,69						
GBP	375.000	Sherwood Financing plc 6.00% 15/11/2026	368.988	0,29						
Total de Reino Unido			1.577.582	1,24						

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2023

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos				Bonos (continuación)					
BERMUDAS				ISLAS CAIMÁN (continuación)					
USD	200.000	Ooredoo International Finance Limited 2.63% 08/04/2031	166.793	0,46	USD	200.000	Vale Overseas Limited 3.75% 08/07/2030	171.212	0,47
Total de Bermudas			166.793	0,46	Total de Islas Caimán			3.346.727	9,14
BRASIL				CHILE					
USD	500.000	Light Servicos de Eletricidade SA 4.38% 18/06/2026	224.375	0,61	USD	263.000	Corporacion Nacional del Cobre de Chile 5.95% 08/01/2034	255.327	0,70
Total de Brasil			224.375	0,61	Total de Chile			255.327	0,70
CANADÁ				COLOMBIA					
USD	500.000	MEGlobal Canada ULCDL 5.00% 18/05/2025	488.343	1,35	USD	250.000	Ecopetrol SA 5.88% 28/05/2045	165.025	0,45
Total de Canadá			488.343	1,35	USD	300.000	Ecopetrol SA 6.88% 29/04/2030	273.934	0,75
Total de Colombia					Total de Colombia			438.959	1,20
ISLAS CAIMÁN				GUATEMALA					
USD	400.000	AAC Technologies Holdings Inc. 3.75% 02/06/2031	277.245	0,76	USD	460.000	CT Trust 5.13% 03/02/2032	363.975	0,99
Total de Guatemala					Total de Guatemala			363.975	0,99
USD	200.000	CK Hutchison International 17 II Limited 3.25% 29/09/2027	183.197	0,50	HONG KONG				
USD	300.000	Country Garden Holdings Company Limited 2.70% 12/07/2026	20.019	0,05	USD	330.000	Xiaomi Best Time International Limited 2.88% 14/07/2031	246.054	0,67
USD	440.000	Country Garden Holdings Company Limited 3.13% 22/10/2025	29.753	0,08	USD	200.000	Xiaomi Best Time International Limited 2.88% 14/07/2031	149.124	0,41
Total de Hong Kong					Total de Hong Kong			395.178	1,08
USD	212.000	ENN Energy Holdings Limited 2.63% 17/09/2030	170.641	0,47	INDIA				
USD	400.000	Goodman HK Finance 3.00% 22/07/2030	326.313	0,89	USD	250.000	Adani Electricity Mumbai Limited 3.95% 12/02/2030	184.768	0,51
USD	400.000	IHS Holding Limited 6.25% 29/11/2028	304.693	0,83	USD	200.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.20% 04/08/2027	170.112	0,47
USD	400.000	Meituan 3.05% 28/10/2030	311.257	0,85	USD	400.000	GMR Hyderabad International Airport 4.25% 27/10/2027	357.245	0,98
USD	400.000	Melco Resorts Finance Limited 5.75% 21/07/2028	349.880	0,96	USD	200.000	GMR Hyderabad International Airport 4.75% 02/02/2026	189.336	0,52
USD	200.000	MGM China Holdings Limited 4.75% 01/02/2027	180.250	0,49	USD	230.000	Indian Railway Finance Corp. Limited 2.80% 10/02/2031	185.042	0,50
USD	200.000	QNB Finance Limited 2.75% 12/02/2027	183.216	0,50	USD	200.000	Indian Railway Finance Corp. Limited 3.57% 21/01/2032	166.883	0,46
USD	200.000	QNB Finance Limited 2.75% 12/02/2027	183.216	0,50	USD	400.000	JSW Steel Limited 3.95% 05/04/2027	351.621	0,96
USD	355.000	Saudi Electricity Sukuk Programme Company 5.68% 11/04/2053	318.234	0,87	USD	250.000	Reliance Industries Limited 3.67% 30/11/2027	232.115	0,64
USD	367.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp. 1.63% 24/09/2025	337.601	0,92					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*				
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)							
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)							
INDIA (continuación)				LUXEMBURGO (continuación)							
USD	475.000	ReNew Wind Energy AP2 4.50% 14/07/2028	398.077	1,09	USD	200.000	Hidrovias Int Finance Sar 4.95% 08/02/2031	160.573	0,44		
		Total de India	2.235.199	6,13	USD	250.000	MHP Lux SA 6.95% 03/04/2026	178.438	0,49		
				USD	544.500	Millicom International Cellular SA 6.25% 25/03/2029	464.254	1,27			
						Total de Luxemburgo	999.463	2,74			
INDONESIA				MAURICIO							
USD	295.000	Bank Mandiri Persero Tbk PT 4.75% 13/05/2025	289.722	0,79	USD	200.000	Greenko Solar Mauritius Limited 5.55% 29/01/2025	193.521	0,53		
USD	250.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 5.45% 15/05/2030	233.834	0,64	USD	400.000	HTA Group Limited/Mauritius 7.00% 18/12/2025	385.378	1,05		
USD	200.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 6.76% 15/11/2048	182.790	0,50			Total de Mauricio	578.899	1,58		
USD	600.000	Sri Rejeki Isman TBK PT 7.25% 16/01/2025	19.650	0,05							
		Total de Indonesia	725.996	1,98							
IRLANDA				MÉXICO							
USD	400.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC 2.60% 16/09/2028	246.400	0,67	USD	500.000	BBVA Bancomer SA FRN 13/09/2034	438.113	1,20		
		Total de Irlanda	246.400	0,67	USD	400.000	Braskem Idesa SAPI 6.99% 20/02/2032	242.523	0,66		
				USD	200.000	Cemex SAB de CV - Perp FRN	208.625	0,57			
				USD	237.000	Gruma SAB de CV 4.88% 01/12/2024	233.889	0,64			
				USD	400.000	Sitios Latinoamerica SAB de CV 5.38% 04/04/2032	343.413	0,94			
						Total de México	1.466.563	4,01			
ISLA DE MAN				MARRUECOS							
USD	200.000	AngloGold Ashanti Holdings plc 3.75% 01/10/2030	161.576	0,44	USD	240.000	OCP SA 3.75% 23/06/2031	190.416	0,52		
USD	400.000	Gohl Capital Limited 4.25% 24/01/2027	369.444	1,01	USD	557.000	OCP SA 6.88% 25/04/2044	470.012	1,30		
		Total de Isla de Man	531.020	1,45			Total de Marruecos	660.428	1,82		
JERSEY - ISLAS DEL CANAL				PAÍSES BAJOS							
USD	200.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.63% 31/03/2036	156.217	0,43	USD	330.000	Braskem Netherlands Finance BV 4.50% 31/01/2030	268.649	0,73		
USD	440.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 3.25% 30/09/2040	320.564	0,87	USD	200.000	Braskem Netherlands Finance BV 5.88% 31/01/2050	143.561	0,39		
		Total de Jersey - Islas del Canal	476.781	1,30	USD	200.000	Braskem Netherlands Finance BV 8.50% 12/01/2031	198.310	0,54		
				USD	351.500	Greenko Dutch BV 3.85% 29/03/2026	317.850	0,86			
KAZAJISTÁN				USD				300.000	MEGlobal BV 2.63% 28/04/2028	259.660	0,71
USD	600.000	KazMunayGas National Company JSC 6.38% 24/10/2048	492.847	1,36	USD	230.000	Metinvest BV 8.50% 23/04/2026	164.826	0,45		
		Total de Kazajistán	492.847	1,36	USD	500.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	454.378	1,24		
LUXEMBURGO											
USD	200.000	Greensaif Pipelines Bidco Sarl 6.13% 23/02/2038	196.198	0,54							

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
PAÍSES BAJOS (continuación)				ARABIA SAUDÍ (continuación)					
USD	392.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 3.15% 01/10/2026	350.104	0,96	USD	100.000	Saudi Arabian Oil Company 3.50% 16/04/2029	90.366	0,25
USD	250.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 4.75% 09/05/2027	231.065	0,63	USD	200.000	Saudi Arabian Oil Company 3.50% 16/04/2029	180.732	0,49
USD	200.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 7.88% 15/09/2029	202.800	0,55	USD	300.000	Saudi Arabian Oil Company 3.50% 24/11/2070	179.139	0,49
Total de Países Bajos			2.591.203	7,06	Total de Arabia Saudí			1.174.684	3,21
PERÚ				SINGAPUR					
USD	200.000	Hunt Oil Co of Peru LLC Sucursal Del Peru 8.55% 18/09/2033	202.250	0,55	USD	200.000	BOC Aviation Limited 2.63% 17/09/2030	163.695	0,45
USD	95.000	Volcan Cia Minera SA 4.38% 11/02/2026	54.820	0,15	USD	600.000	DBS Group Holdings Limited FRN 11/12/2028	598.088	1,64
Total de Perú			257.070	0,70	USD	200.000	SingTel Group Treasury Pte Limited 2.38% 28/08/2029	170.690	0,47
FILIPINAS				SUDÁFRICA					
USD	250.000	Globe Telecom Inc. 2.50% 23/07/2030	199.566	0,55	USD	250.000	Eskom Holdings SOC Limited 7.13% 11/02/2025	244.613	0,67
USD	200.000	International Container Terminal SE 4.75% 17/06/2030	188.540	0,51	Total de Sudáfrica			244.613	0,67
USD	200.000	PLDT Inc. 2.50% 23/01/2031	159.215	0,44	TAILANDIA				
USD	600.000	Smc Global Power Holdings Corp. - Perp FRN	432.409	1,18	USD	700.000	Bangkok Bank pcl FRN 25/09/2034	585.544	1,60
Total de Filipinas			979.730	2,68	USD	235.000	GC Treasury Center Company Limited 4.30% 18/03/2051	155.085	0,42
CATAR				TURQUÍA					
USD	610.000	QatarEnergy 2.25% 12/07/2031	489.315	1,34	USD	200.000	GC Treasury Centre Company 2.98% 18/03/2031	158.291	0,43
Total de Catar			489.315	1,34	USD	200.000	Kasikornbank pcl FRN 02/10/2031	178.345	0,49
REPÚBLICA DE COREA (SUR)				Total de Tailandia					
USD	200.000	Kookmin Bank 4.50% 01/02/2029	184.607	0,50	Total de Tailandia			1.077.265	2,94
USD	373.000	LG Energy Solution Limited 5.63% 25/09/2026	371.637	1,02	TURQUÍA				
USD	500.000	SK Hynix Inc. 6.50% 17/01/2033	492.333	1,34	USD	380.000	KOC Holding AS 6.50% 11/03/2025	376.200	1,03
Total de República de Corea (Sur)			1.048.577	2,86	USD	250.000	Turk Telekomunikasyon AS 6.88% 28/02/2025	244.908	0,67
ARABIA SAUDÍ				Total de Turquía					
USD	400.000	Saudi Arabian Oil Company 2.25% 24/11/2030	321.976	0,88	Total de Turquía			621.108	1,70
USD	500.000	Saudi Arabian Oil Company 2.25% 24/11/2030	402.471	1,10					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda					
EMIRATOS ÁRABES UNIDOS				EGIPTO					
USD	700.000	DP World Limited 6.85% 02/07/2037	726.419	1,99	USD	400.000	Egypt (Govt of) 7.63% 29/05/2032	232.444	0,64
Total de Emiratos Árabes Unidos			726.419	1,99	Total de Egipto			232.444	0,64
REINO UNIDO				TURQUÍA					
USD	300.000	Gazprom PJSC Via Gaz Finance plc 3.25% 25/02/2030	179.991	0,49	USD	350.000	Turkey (Govt of) 6.00% 25/03/2027	327.886	0,89
USD	200.000	Marb Bondco plc 3.95% 29/01/2031	148.510	0,41	Total de Turquía			327.886	0,89
USD	450.000	Nak Naftogaz Ukraine Via Kondor Finance plc 7.63% 08/11/2026	214.547	0,59	Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				
USD	200.000	Tullow Oil plc 7.00% 01/03/2025	154.806	0,42	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa			29.892.381	81,74
Total de Reino Unido			697.854	1,91	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				
ESTADOS UNIDOS				Bonos					
USD	300.000	Sasol Financing USA LLC 5.50% 18/03/2031	234.916	0,64	BERMUDAS				
USD	300.000	Sasol Financing USA LLC 8.75% 03/05/2029	289.124	0,79	USD	400.000	Tengizchevroil Finance Company International Limited 3.25% 15/08/2030	305.107	0,83
Total de Estados Unidos			524.040	1,43	Total de Bermudas			305.107	0,83
ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)				LUXEMBURGO					
USD	460.000	Central American Bottling Corp. 5.25% 27/04/2029	416.300	1,14	USD	500.000	Altice Financing SA 5.00% 15/01/2028	427.813	1,17
USD	200.000	Champion Path Holding 4.85% 27/01/2028	161.453	0,44	Total de Luxemburgo			427.813	1,17
USD	400.000	Elect Global Investments Limited - Perp FRN	328.747	0,91	Total de bonos				
USD	450.000	FPC Resources Limited 4.38% 11/09/2027	430.425	1,17	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente			732.920	2,00
USD	511.000	HKT Capital No 5 Limited 3.25% 30/09/2029	446.642	1,21	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				
USD	728.000	Jgsh Philippines Limited 4.13% 09/07/2030	657.496	1,80	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente			732.920	2,00
USD	800.000	Studio City Finance Limited 5.00% 15/01/2029	604.308	1,65	Total de bonos				
USD	467.000	TSMC Global Limited 0.75% 28/09/2025	423.774	1,16	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente			732.920	2,00
Total de Islas Vírgenes (Británicas)			3.469.145	9,48	Total de bonos				
Total de bonos			29.332.051	80,21	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario			
Bonos			
ISLAS CAIMÁN			
USD	200.000	CIFI Holdings Group Company Limited 0.00% 16/07/2025	14.198 0,04
		Total de Islas Caimán	14.198 0,04
		Total de bonos	14.198 0,04
		Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario	14.198 0,04
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
	2.615.460	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	2.615.460 7,15
		Total de Irlanda	2.615.460 7,15
		Total de fondos	2.615.460 7,15
		Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	2.615.460 7,15
		Valor total de las inversiones	33.254.959 90,93
		(Coste total: 38.646.085 USD)	

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2023

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos				Bonos (continuación)					
AZERBAIYÁN				IRLANDA					
USD	200.000	Azerbaijan (Govt of) 3.50% 01/09/2032	163.285	0,64	USD	200.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC 2.60% 16/09/2028	123.200	0,48
Total de Azerbaiyán			163.285	0,64	Total de Irlanda			123.200	0,48
BERMUDAS				ISLA DE MAN					
USD	200.000	Ooredoo International Finance Limited 2.63% 08/04/2031	166.793	0,65	USD	200.000	AngloGold Ashanti Holdings plc 3.75% 01/10/2030	161.576	0,63
Total de Bermudas			166.793	0,65	Total de Isla de Man			161.576	0,63
ISLAS CAIMÁN				JERSEY - ISLAS DEL CANAL					
USD	350.000	Country Garden Holdings Company Limited 2.70% 12/07/2026	23.356	0,09	USD	253.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.63% 31/03/2036	197.615	0,77
USD	319.000	Gaci First Investment Company 4.88% 14/02/2035	289.569	1,14	USD	263.108	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.94% 30/09/2040	203.148	0,80
USD	400.000	Gaci First Investment Company 5.13% 14/02/2053	326.608	1,28	Total de Jersey - Islas del Canal			400.763	1,57
Total de Islas Caimán			639.533	2,51	KAZAJISTÁN				
CHILE				LUXEMBURGO					
USD	263.000	Corporacion Nacional del Cobre de Chile 5.95% 08/01/2034	255.327	1,00	USD	200.000	Greensaif Pipelines Bidco Sarl 6.13% 23/02/2038	196.198	0,77
USD	200.000	Empresa Nacional del Petroleo 6.15% 10/05/2033	192.767	0,76	Total de Luxemburgo			196.198	0,77
Total de Chile			448.094	1,76	MALASIA				
HONG KONG				MÉXICO					
USD	210.000	Xiaomi Best Time International Limited 2.88% 14/07/2031	156.580	0,61	USD	450.000	Comision Federal de Electricidad 3.88% 26/07/2033	342.413	1,35
Total de Hong Kong			156.580	0,61	USD	300.000	Petroleos Mexicanos 5.95% 28/01/2031	214.777	0,84
INDIA				MÉXICO					
USD	200.000	Adani Electricity Mumbai Limited 3.95% 12/02/2030	147.814	0,58	USD	545.000	Petroleos Mexicanos 6.70% 16/02/2032	405.582	1,60
Total de India			147.814	0,58	USD	200.000	Petroleos Mexicanos 7.69% 23/01/2050	129.079	0,51
INDONESIA				MÉXICO					
USD	400.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 5.80% 15/05/2050	325.025	1,28	Total de México			877.072	3,46
Total de Indonesia			325.025	1,28					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
MÉXICO (continuación)				REINO UNIDO					
USD	96.000	Petroleos Mexicanos 10.00% 07/02/2033	85.608	0,34	USD	204.000	Gazprom PJSC Via Gaz Finance plc 3.25% 25/02/2030	122.394	0,48
					USD	230.000	Tullow Oil plc 7.00% 01/03/2025	178.027	0,70
		Total de México	1.177.459	4,64			Total de Reino Unido	300.421	1,18
PAÍSES BAJOS				ESTADOS UNIDOS					
USD	200.000	Braskem Netherlands Finance BV 5.88% 31/01/2050	143.561	0,56	USD	378.000	Petroleos Mexicanos 6.63% 15/06/2035	253.812	0,99
USD	200.000	Braskem Netherlands Finance BV 8.50% 12/01/2031	198.310	0,79	USD	200.000	Sasol Financing USA LLC 5.50% 18/03/2031	156.611	0,61
USD	250.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	227.189	0,89			Total de Estados Unidos	410.423	1,60
		Total de Países Bajos	569.060	2,24					
PERÚ				ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)					
USD	200.000	Hunt Oil Co of Peru LLC Sucursal Del Peru 8.55% 18/09/2033	202.250	0,79	USD	489.000	Jgsh Philippines Limited 4.13% 09/07/2030	441.642	1,73
		Total de Perú	202.250	0,79	USD	200.000	State Grid Overseas Investment 2016 Limited 1.63% 05/08/2030	159.610	0,63
CATAR				Total de Islas Vírgenes (Británicas)					
USD	356.000	QatarEnergy 2.25% 12/07/2031	285.567	1,12			801.429	3,14	
		Total de Catar	285.567	1,12	Total de bonos		8.983.015	35,22	
ARABIA SAUDÍ				Valores respaldados por hipotecas y activos					
USD	400.000	Saudi Arabian Oil Company 2.25% 24/11/2030	321.976	1,26	LUXEMBURGO				
		Total de Arabia Saudí	321.976	1,26	USD	180.000	Millicom International Cellular SA 5.13% 15/01/2028	151.898	0,60
SUDÁFRICA				Total de Luxemburgo					
USD	200.000	Eskom Holdings SOC Limited 7.13% 11/02/2025	195.690	0,77			151.898	0,60	
		Total de Sudáfrica	195.690	0,77	Total de valores respaldados por hipotecas y activos		151.898	0,60	
EMIRATOS ÁRABES UNIDOS				Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda					
USD	200.000	Abu Dhabi Ports Company PJSC 2.50% 06/05/2031	163.540	0,64	ANGOLA				
USD	500.000	DP World Limited 6.85% 02/07/2037	518.871	2,03	USD	200.000	Angola (Govt of) 8.00% 26/11/2029	165.065	0,65
USD	200.000	MDGH GMTN RSC Limited 5.08% 22/05/2053	177.577	0,70	USD	200.000	Angola (Govt of) 9.38% 08/05/2048	148.290	0,58
USD	200.000	MDGH GMTN RSC Limited 5.50% 28/04/2033	199.847	0,78			Total de Angola	313.355	1,23
		Total de Emiratos Árabes Unidos	1.059.835	4,15	ARGENTINA				
					USD	1.750.000	Argentina (Govt of) FRN 09/07/2035	436.538	1,71

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)				Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)					
ARGENTINA (continuación)				REPÚBLICA DOMINICANA (continuación)					
USD	90.000	Argentina (Govt of) 3.63% 09/07/2046	22.806	0,09	USD	106.000	Dominican Republic (Govt of) 7.45% 30/04/2044	97.179	0,38
Total de Argentina			459.344	1,80	Total de República Dominicana			706.536	2,77
BARÉIN				ECUADOR					
USD	333.000	CBB International Sukuk Programme Company WLL 3.88% 18/05/2029	293.854	1,15	USD	192.950	Ecuador (Govt of) 2.50% 31/07/2040	63.557	0,25
Total de Baréin			293.854	1,15	USD	344.160	Ecuador (Govt of) 3.50% 31/07/2035	128.423	0,50
BRASIL				EGIPTO					
USD	200.000	Brazil (Govt of) 5.00% 27/01/2045	148.662	0,58	USD	100.000	Ecuador (Govt of) 6.00% 31/07/2030	51.305	0,20
Total de Brasil			148.662	0,58	Total de Ecuador			243.285	0,95
CHILE				HUNGRÍA					
USD	200.000	Chile (Govt of) 3.50% 25/01/2050	133.911	0,52	EUR	200.000	Egypt (Govt of) 6.38% 11/04/2031	118.824	0,47
Total de Chile			133.911	0,52	USD	250.000	Egypt (Govt of) 7.30% 30/09/2033	140.264	0,55
CHINA				INDIA					
USD	200.000	China (Govt of) 1.95% 03/12/2024	192.413	0,75	USD	450.000	Egypt (Govt of) 7.63% 29/05/2032	261.499	1,03
Total de China			192.413	0,75	USD	300.000	Egypt (Govt of) 7.90% 21/02/2048	154.631	0,61
COLOMBIA				Total de Egipto					
USD	400.000	Colombia (Govt of) 3.00% 30/01/2030	308.656	1,21	675.218			2,66	
USD	350.000	Colombia (Govt of) 3.13% 15/04/2031	260.143	1,02	HUNGRÍA				
USD	223.000	Colombia (Govt of) 3.25% 22/04/2032	160.958	0,63	USD	200.000	Hungary (Govt of) 2.13% 22/09/2031	148.119	0,58
Total de Colombia			729.757	2,86	EUR	58.000	Hungary (Govt of) 5.00% 22/02/2027	61.778	0,24
CROACIA				Total de Hungría					
USD	200.000	Croatia (Govt of) 6.00% 26/01/2024	200.074	0,78	399.768			1,56	
Total de Croacia			200.074	0,78	INDONESIA				
REPÚBLICA DOMINICANA				INDONESIA					
USD	600.000	Dominican Republic (Govt of) 4.88% 23/09/2032	489.219	1,92	USD	200.000	Indonesia (Govt of) 3.70% 30/10/2049	140.100	0,55
USD	151.000	Dominican Republic (Govt of) 6.40% 05/06/2049	120.138	0,47	USD	200.000	Indonesia (Govt of) 4.30% 31/03/2052	155.446	0,61
Total de República Dominicana			609.357	2,39	USD	350.000	Indonesia (Govt of) 4.75% 18/07/2047	300.112	1,18
				Total de India					
					IDR	5.360.000.000	Indonesia (Govt of) 6.38% 15/04/2032	338.125	1,33

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)				Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)					
INDONESIA (continuación)				PANAMÁ					
USD	200.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 2.30% 23/06/2025	188.752	0,74	USD	200.000	Panama (Govt of) 2.25% 29/09/2032	145.402	0,57
Total de Indonesia			1.122.535	4,41	USD	302.000	Panama (Govt of) 3.30% 19/01/2033	236.746	0,93
COSTA DE MARFIL				PARAGUAY					
EUR	477.000	Ivory Coast (Govt of) 5.88% 17/10/2031	417.127	1,64	USD	200.000	Panama (Govt of) 4.50% 19/01/2063	130.174	0,51
Total de Costa de Marfil			417.127	1,64	Total de Panamá			512.322	2,01
JORDANIA				PERÚ					
USD	200.000	Jordan (Govt of) 7.50% 13/01/2029	195.849	0,77	USD	340.000	Paraguay (Govt of) 5.60% 13/03/2048	276.360	1,08
Total de Jordania			195.849	0,77	USD	200.000	Paraguay (Govt of) 6.10% 11/08/2044	175.781	0,69
MÉXICO				FILIPINAS					
USD	650.000	Mexico (Govt of) 3.25% 16/04/2030	554.514	2,16	USD	339.000	Philippine (Govt of) 3.20% 06/07/2046	224.089	0,88
USD	300.000	Mexico (Govt of) 4.60% 10/02/2048	219.699	0,86	Total de Filipinas			224.089	0,88
MXN	85.000	Mexico (Govt of) 8.50% 31/05/2029	457.904	1,80	CATAR				
Total de México			1.232.117	4,82	USD	200.000	Qatar (Govt of) 4.40% 16/04/2050	163.414	0,64
MONGOLIA				RUMANÍA					
USD	200.000	Mongolia (Govt of) 8.65% 19/01/2028	199.192	0,78	USD	252.000	Romania (Govt of) 3.00% 27/02/2027	229.486	0,90
Total de Mongolia			199.192	0,78	USD	300.000	Romania (Govt of) 4.00% 14/02/2051	192.123	0,75
NIGERIA				ARABIA SAUDÍ					
USD	250.000	Nigeria (Govt of) 7.38% 28/09/2033	185.710	0,73	USD	300.000	Saudi (Govt of) 3.45% 02/02/2061	184.429	0,72
Total de Nigeria			185.710	0,73	USD	500.000	Saudi (Govt of) 3.75% 21/01/2055	332.689	1,30
OMÁN									
USD	220.000	Oman (Govt of) 6.75% 17/01/2048	202.825	0,80	PAKISTÁN				
Total de Omán			202.825	0,80	USD	200.000	Pakistan (Govt of) 6.88% 05/12/2027	103.314	0,41
				Total de Pakistán					
			103.314	0,41					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*				
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario							
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)				Bonos							
ARABIA SAUDÍ (continuación)				VENEZUELA							
USD	239.000	Saudi (Govt of) 4.88% 18/07/2033	227.220	0,89	USD	1.999.683	Petroleos de Venezuela SA 6.00% 15/11/2026	114.982	0,45		
Total de Arabia Saudí			744.338	2,91	Total de Venezuela			114.982	0,45		
SUDÁFRICA				Total de bonos				114.982	0,45		
USD	300.000	South Africa (Govt of) 5.75% 30/09/2049	199.921	0,78	Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda						
Total de Sudáfrica			199.921	0,78	VENEZUELA						
TURQUÍA				VENEZUELA							
USD	230.000	Turkey (Govt of) 5.13% 17/02/2028	205.978	0,81	USD	2.004.400	Venezuela (Govt of) 8.25% 13/10/2024	200.440	0,79		
USD	225.000	Turkey (Govt of) 6.00% 25/03/2027	210.784	0,83	Total de Venezuela			200.440	0,79		
USD	250.000	Turkey (Govt of) 6.88% 17/03/2036	212.474	0,83	Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda						
USD	375.000	Turkey (Govt of) 9.38% 19/01/2033	382.785	1,50	Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario						
Total de Turquía			1.012.021	3,97				315.422	1,24		
UCRANIA				Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios							
USD	518.000	Ukraine (Govt of) 0.00% 21/05/2031	138.908	0,54	Fondos						
USD	560.000	Ukraine (Govt of) 7.75% 01/09/2026	164.575	0,65	IRLANDA						
Total de Ucrania			303.483	1,19	1.879.862	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	1.879.862	7,37			
Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				13.193.897	51,71	Total de Irlanda			1.879.862	7,37	
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				22.328.810	87,53	Total de fondos				1.879.862	7,37
						Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios				1.879.862	7,37
						Valor total de las inversiones				24.524.094	96,14
						(Coste total: 31.511.138 USD)					

* Diferencias menores debido al redondeo.

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

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2023

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos				Bonos (continuación)					
BRASIL				INDIA (continuación)					
USD	600.000	Light Servicios de Eletricidade SA 4.38% 18/06/2026	269.250	0,50	USD	700.000	ReNew Wind Energy AP2 4.50% 14/07/2028	586.640	1,09
Total de Brasil			269.250	0,50	Total de India			1.383.411	2,58
CANADÁ				INDONESIA					
USD	400.000	MEGlobal Canada ULCDL 5.00% 18/05/2025	390.674	0,73	USD	1.200.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 4.75% 15/05/2025	1.175.546	2,18
Total de Canadá			390.674	0,73	USD	800.000	Perusahaan Perseroan Persero PT 4.13% 15/05/2027	752.359	1,40
ISLAS CAIMÁN				IRLANDA					
USD	400.000	AAC Technologies Holdings Inc. 3.75% 02/06/2031	277.245	0,52	USD	400.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC 2.60% 16/09/2028	246.400	0,46
USD	200.000	Country Garden Holdings Company Limited 2.70% 12/07/2026	13.346	0,02	Total de Irlanda			246.400	0,46
USD	700.000	Country Garden Holdings Company Limited 3.13% 22/10/2025	47.335	0,09	JERSEY - ISLAS DEL CANAL				
USD	975.000	Gaci First Investment Company 5.00% 13/10/2027	953.312	1,78	USD	1.021.118	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 1.75% 30/09/2027	944.219	1,76
USD	350.000	IHS Holding Limited 6.25% 29/11/2028	266.606	0,50	Total de Jersey - Islas del Canal			944.219	1,76
USD	650.000	Meituan 3.05% 28/10/2030	505.793	0,94	LUXEMBURGO				
USD	500.000	MGM China Holdings Limited 4.75% 01/02/2027	450.625	0,84	USD	500.000	Gazprom PJSC Via Gaz Capital SA 5.15% 11/02/2026	385.000	0,72
USD	1.300.000	SA Global Sukuk Limited 1.60% 17/06/2026	1.173.315	2,18	USD	750.000	Millicom International Cellular SA 4.50% 27/04/2031	536.719	1,00
Total de Islas Caimán			3.687.577	6,87	USD	200.000	TMS Issuer Sarl 5.78% 23/08/2032	200.250	0,37
COLOMBIA				MAURICIO					
USD	695.000	Ecopetrol SA 8.63% 19/01/2029	698.329	1,30	USD	600.000	HTA Group Limited/Mauritius 7.00% 18/12/2025	578.066	1,08
Total de Colombia			698.329	1,30	Total de Mauricio			578.066	1,08
HONG KONG				MÉXICO					
USD	500.000	Lenovo Group Limited 5.88% 24/04/2025	497.302	0,93	USD	800.000	Petroleos Mexicanos 6.49% 23/01/2027	710.000	1,32
USD	600.000	Xiaomi Best Time International Limited 2.88% 14/07/2031	447.372	0,83	USD	1.100.000	Petroleos Mexicanos 6.50% 13/03/2027	970.107	1,81
Total de Hong Kong			944.674	1,76					
INDIA									
USD	400.000	GMR Hyderabad International Airport 4.25% 27/10/2027	357.245	0,67					
USD	500.000	JSW Steel Limited 3.95% 05/04/2027	439.526	0,82					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

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

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
MÉXICO (continuación)				REINO UNIDO					
USD	800.000	Petroleos Mexicanos 6.88% 16/10/2025	768.227	1,43	USD	200.000	Nak Naftogaz Ukraine Via Kondor Finance plc 7.63% 08/11/2026	95.354	0,18
USD	1.200.000	Petroleos Mexicanos 6.88% 04/08/2026	1.105.891	2,06	USD	600.000	Tullow Oil plc 7.00% 01/03/2025	464.419	0,86
		Total de México	3.554.225	6,62			Total de Reino Unido	559.773	1,04
PAÍSES BAJOS				ESTADOS UNIDOS					
USD	421.000	Braskem Netherlands Finance BV 7.25% 13/02/2033	387.625	0,72	USD	300.000	Sasol Financing USA LLC 8.75% 03/05/2029	289.124	0,54
USD	200.000	Braskem Netherlands Finance BV 8.50% 12/01/2031	198.310	0,37			Total de Estados Unidos	289.124	0,54
USD	869.500	Greenko Dutch BV 3.85% 29/03/2026	786.261	1,47	ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)				
USD	400.000	MEGlobal BV 2.63% 28/04/2028	346.213	0,64	USD	800.000	Central American Bottling Corp. 5.25% 27/04/2029	724.000	1,35
USD	500.000	Metinvest BV 8.50% 23/04/2026	358.318	0,67	USD	1.000.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 5.13% 15/05/2024	992.902	1,85
		Total de Países Bajos	2.076.727	3,87	USD	700.000	Studio City Finance Limited 6.00% 15/07/2025	662.882	1,23
PERÚ				Total de Islas Vírgenes (Británicas)					
USD	200.000	Hunt Oil Co of Peru LLC Sucursal Del Peru 8.55% 18/09/2033	202.250	0,38	USD	700.000	TSMC Global Limited 0.75% 28/09/2025	635.208	1,18
		Total de Perú	202.250	0,38			Total de Islas Vírgenes (Británicas)	3.014.992	5,61
CATAR				Total de bonos					
USD	700.000	QatarEnergy 1.38% 12/09/2026	625.766	1,17	24.181.805 45,04				
		Total de Catar	625.766	1,17	Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				
REPÚBLICA DE COREA (SUR)				ANGOLA					
USD	549.000	LG Energy Solution Limited 5.63% 25/09/2026	546.994	1,02	USD	800.000	Angola (Govt of) 8.25% 09/05/2028	695.913	1,30
		Total de República de Corea (Sur)	546.994	1,02			Total de Angola	695.913	1,30
ARABIA SAUDÍ				ARGENTINA					
USD	350.000	Saudi Arabian Oil Company 2.88% 16/04/2024	344.157	0,64	USD	2.500.000	Argentina (Govt of) 0.75% 09/07/2030	717.563	1,34
USD	450.000	Saudi Arabian Oil Company 2.88% 16/04/2024	442.488	0,82			Total de Argentina	717.563	1,34
		Total de Arabia Saudí	786.645	1,46	BRASIL				
SUDÁFRICA				USD	1.500.000	Brazil (Govt of) 2.88% 06/06/2025	1.427.571	2,66	
USD	300.000	Eskom Holdings SOC Limited 7.13% 11/02/2025	293.535	0,55	USD	400.000	Brazil (Govt of) 4.25% 07/01/2025	391.317	0,73
		Total de Sudáfrica	293.535	0,55			Total de Brasil	1.818.888	3,39

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

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

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)				Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)					
COLOMBIA				INDONESIA					
USD	500.000	Colombia (Govt of) 3.13% 15/04/2031	371.633	0,69	USD	640.000	Indonesia (Govt of) 4.55% 11/01/2028	619.868	1,15
Total de Colombia			371.633	0,69	Total de Indonesia			619.868	1,15
COSTA RICA				COSTA DE MARFIL					
USD	300.000	Costa Rica (Govt of) 4.38% 30/04/2025	292.046	0,54	EUR	900.000	Ivory Coast (Govt of) 5.25% 22/03/2030	798.972	1,49
Total de Costa Rica			292.046	0,54	Total de Costa de Marfil			798.972	1,49
REPÚBLICA DOMINICANA				JORDANIA					
USD	1.000.000	Dominican Republic (Govt of) 5.50% 27/01/2025	989.084	1,84	USD	200.000	Jordan (Govt of) 7.50% 13/01/2029	195.849	0,36
USD	1.000.000	Dominican Republic (Govt of) 6.85% 29/01/2026	1.000.923	1,86	Total de Jordania			195.849	0,36
Total de República Dominicana			1.990.007	3,70	MONGOLIA				
ECUADOR				MARRUECOS					
USD	1.300.000	Ecuador (Govt of) 6.00% 31/07/2030	666.965	1,24	USD	320.000	Morocco (Govt of) 5.95% 08/03/2028	316.322	0,59
Total de Ecuador			666.965	1,24	Total de Marruecos			316.322	0,59
EGIPTO				NIGERIA					
USD	700.000	Egypt (Govt of) 3.88% 16/02/2026	499.786	0,93	USD	900.000	Nigeria (Govt of) 6.50% 28/11/2027	753.858	1,40
USD	400.000	Egypt (Govt of) 5.25% 06/10/2025	309.793	0,58	Total de Nigeria			753.858	1,40
USD	400.000	Egypt (Govt of) 5.80% 30/09/2027	264.912	0,49	OMÁN				
USD	650.000	Egypt (Govt of) 6.59% 21/02/2028	424.242	0,79	USD	1.700.000	Oman (Govt of) 4.75% 15/06/2026	1.652.351	3,09
Total de Egipto			1.498.733	2,79	Total de Omán			1.652.351	3,09
HUNGRÍA				PAKISTÁN					
EUR	174.000	Hungary (Govt of) 5.00% 22/02/2027	185.335	0,35	USD	500.000	Pakistan (Govt of) 6.00% 08/04/2026	261.685	0,49
USD	307.000	Hungary (Govt of) 6.13% 22/05/2028	306.782	0,57	USD	200.000	Pakistan (Govt of) 8.25% 30/09/2025	124.050	0,23
Total de Hungría			492.117	0,92	Total de Pakistán			385.735	0,72
INDIA									
USD	600.000	Export-Import Bank of India 3.38% 05/08/2026	563.705	1,05					
Total de India			563.705	1,05					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

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

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)				Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)					
PANAMÁ				UCRANIA					
USD	1.350.000	Panamá (Govt of) 3.75% 16/03/2025	1.306.803	2,43	USD	2.300.000	Ukraine (Govt of) 7.75% 01/09/2026	675.931	1,26
Total de Panamá			1.306.803	2,43	Total de Ucrania			675.931	1,26
CATAR				Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda					
USD	1.500.000	Qatar (Govt of) 3.25% 02/06/2026	1.430.671	2,66	21.974.570				
Total de Catar			1.430.671	2,66	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				
RUMANÍA				46.156.375					
USD	646.000	Romania (Govt of) 3.00% 27/02/2027	588.286	1,10	85,97				
Total de Rumanía			588.286	1,10	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				
SUDÁFRICA				Bonos					
USD	600.000	South Africa (Govt of) 4.30% 12/10/2028	520.987	0,97	BERMUDAS				
USD	350.000	South Africa (Govt of) 4.85% 30/09/2029	300.992	0,56	USD	500.000	Tengizchevroil Finance Company International Limited 4.00% 15/08/2026	451.825	0,84
Total de Sudáfrica			821.979	1,53	Total de Bermudas			451.825	0,84
SRI LANKA				Total de bonos					
USD	860.000	Sri Lanka (Govt of) 5.75% 18/04/2024	414.248	0,77	451.825				
Total de Sri Lanka			414.248	0,77	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				
TURQUÍA				451.825					
USD	200.000	Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS 7.25% 24/02/2027	196.090	0,37	Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario				
USD	1.100.000	Turkey (Govt of) 4.88% 09/10/2026	1.011.938	1,88	Bonos				
USD	1.600.000	Turkey (Govt of) 6.00% 25/03/2027	1.498.907	2,80	ISLAS CAIMÁN				
Total de Turquía			2.706.935	5,05	USD	600.000	CIFI Holdings Group Company Limited 0.00% 16/07/2025	42.595	0,08
VENEZUELA				Total de Islas Caimán					
USD	3.288.783	Petroleos de Venezuela SA 6.00% 16/05/2024	189.105	0,35	42.595			0,08	
USD	491.751	Petroleos de Venezuela SA 6.00% 15/11/2026	28.276	0,05	Total de Venezuela				
Total de Venezuela			217.381	0,40	Total de bonos				
Total de bonos				259.976					
259.976				0,48					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

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

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario			
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda			
VENEZUELA			
USD	1.245.400	Venezuela (Govt of) 8.25% 13/10/2024	
		124.540	0,23
	Total de Venezuela	124.540	0,23
	Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda	124.540	0,23
	Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario	384.516	0,71
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
	3.641.186	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	
		3.641.186	6,78
	Total de Irlanda	3.641.186	6,78
	Total de fondos	3.641.186	6,78
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	3.641.186	6,78
	Valor total de las inversiones	50.633.902	94,30
	(Coste total: 58.728.895 USD)		

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)			
ESTADOS UNIDOS (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
USD	378.000 Ford Motor Credit Company LLC 4.00% 13/11/2030	316.700	0,26	USD	755.000 Southwestern Energy Company 4.75% 01/02/2032	649.270	0,52
USD	299.000 Ford Motor Credit Company LLC 4.39% 08/01/2026	282.555	0,23	USD	68.000 Southwestern Energy Company 5.70% 23/01/2025	67.023	0,05
USD	244.000 Ford Motor Credit Company LLC 4.95% 28/05/2027	228.732	0,18	USD	233.000 Tenet Healthcare Corp. 6.13% 15/06/2030	218.921	0,18
USD	486.000 Ford Motor Credit Company LLC 5.13% 16/06/2025	470.813	0,38	USD	333.000 TransDigm Inc. 5.50% 15/11/2027	312.713	0,25
USD	176.000 Ford Motor Credit Company LLC 6.80% 12/05/2028	175.692	0,14	USD	555.000 United Airlines Inc. 4.63% 15/04/2029	477.647	0,39
USD	279.000 Ford Motor Credit Company LLC 7.35% 04/11/2027	284.810	0,23	USD	373.000 Yum! Brands Inc. 5.38% 01/04/2032	338.574	0,27
USD	160.000 Goodyear Tire & Rubber Company 5.00% 15/07/2029	138.146	0,11		Total de Estados Unidos	11.457.883	9,24
USD	329.000 HB Fuller Company 4.25% 15/10/2028	289.680	0,23		Total de bonos	16.426.684	13,24
USD	391.000 Navient Corp. 6.75% 25/06/2025	384.955	0,31		Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	16.426.684	13,24
USD	131.000 Newell Brands Inc. 4.70% 01/04/2026	123.713	0,10		Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente		
USD	302.000 NRG Energy Inc. 5.75% 15/01/2028	283.304	0,23		Bonos		
USD	222.000 Nustar Logistics LP 5.75% 01/10/2025	216.524	0,17		BERMUDAS		
USD	266.000 NuStar Logistics LP 5.63% 28/04/2027	254.091	0,21	USD	282.000 Nabors Industries Limited 7.25% 15/01/2026	274.499	0,22
USD	578.000 NuStar Logistics LP 6.00% 01/06/2026	562.665	0,46	USD	55.000 Nabors Industries Limited 7.50% 15/01/2028	51.138	0,04
USD	310.000 Occidental Petroleum Corp. 6.63% 01/09/2030	313.897	0,25	USD	246.000 NCL Corp. Limited 5.88% 15/03/2026	227.243	0,18
USD	62.000 Occidental Petroleum Corp. 7.50% 01/05/2031	65.672	0,05	USD	285.000 Viking Cruises Limited 5.88% 15/09/2027	260.198	0,21
USD	26.000 OneMain Finance Corp 5.38% 15/11/2029	21.809	0,02	USD	96.000 Viking Cruises Limited 9.13% 15/07/2031	96.060	0,08
USD	245.000 OneMain Finance Corp. 4.00% 15/09/2030	183.370	0,15		Total de Bermudas	909.138	0,73
USD	106.000 OneMain Finance Corp. 6.13% 15/03/2024	105.735	0,09		CANADÁ		
USD	253.000 OneMain Finance Corp. 6.88% 15/03/2025	251.109	0,20	USD	570.000 1011778 BC ULC 3.88% 15/01/2028	512.174	0,41
USD	177.000 OneMain Finance Corp. 9.00% 15/01/2029	176.558	0,14	USD	164.000 1011778 BC ULC 4.38% 15/01/2028	148.277	0,12
USD	265.000 Pilgrim's Pride Corp. 4.25% 15/04/2031	221.084	0,18	USD	55.000 1375209 BC Limited 9.00% 30/01/2028	54.654	0,04
USD	475.000 Primo Water Holdings Inc. 4.38% 30/04/2029	408.216	0,33	USD	276.000 Air Canada 3.88% 15/08/2026	250.815	0,20
USD	183.000 Radian Group Inc. 4.88% 15/03/2027	171.071	0,14	USD	249.000 Bausch & Lomb Escrow Corp. 8.38% 01/10/2028	249.778	0,20
USD	291.000 Radian Group Inc. 6.63% 15/03/2025	289.396	0,23				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)						
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)						
CANADÁ (continuación)				FRANCIA						
USD	164.000	Bausch Health Companys Inc. 6.13% 01/02/2027	101.862	0,08	USD	304.000	Altice France SA 5.50% 15/10/2029	219.640	0,18	
USD	196.000	Bausch Health Cos Inc. 4.88% 01/06/2028	112.011	0,09	USD	617.000	Constellium SE 3.75% 15/04/2029	517.878	0,42	
USD	167.000	Bausch Health Cos Inc. 5.50% 01/11/2025	148.421	0,12	USD	346.000	Constellium SE 5.63% 15/06/2028	325.769	0,26	
USD	98.000	Bausch Health Cos Inc. 11.00% 30/09/2028	66.487	0,05	USD	325.000	Iliad Holding Sasu 6.50% 15/10/2026	305.721	0,25	
USD	19.000	Bausch Health Cos Inc. 14.00% 15/10/2030	11.275	0,01	USD	679.000	Iliad Holding SASU 7.00% 15/10/2028	619.133	0,50	
USD	252.000	Baytex Energy Corp. 8.50% 30/04/2030	255.352	0,21	Total de Francia			1.988.141	1,61	
USD	166.000	Clarios Global LP 6.75% 15/05/2025	164.908	0,13	ALEMANIA					
USD	843.000	Hudbay Minerals Inc. 4.50% 01/04/2026	792.247	0,64	USD	261.000	TK Elevator Holdco GmbH 7.63% 15/07/2028	239.714	0,19	
USD	178.000	Hudbay Minerals Inc. 6.13% 01/04/2029	165.082	0,13	Total de Alemania			239.714	0,19	
USD	122.000	Nova Chemicals Corp. 5.00% 01/05/2025	115.816	0,09	IRLANDA					
USD	268.000	Nova Chemicals Corp. 5.25% 01/06/2027	232.877	0,19	USD	313.000	James Hardie International Finance Dac 5.00% 15/01/2028	293.648	0,24	
USD	218.000	Ritchie Bros Holdings Inc. 6.75% 15/03/2028	217.748	0,18	Total de Irlanda			293.648	0,24	
USD	287.000	Ritchie Bros Holdings Inc. 7.75% 15/03/2031	292.143	0,23	LIBERIA					
Total de Canadá				3.891.927	3,12	USD	306.000	Royal Caribbean Cruises Limited 4.25% 01/07/2026	281.279	0,23
ISLAS CAIMÁN						USD	119.000	Royal Caribbean Cruises Limited 5.38% 15/07/2027	110.298	0,09
USD	611.316	Hawaiian Brand Intellectual Property Limited 5.75% 20/01/2026	550.949	0,44	USD	82.000	Royal Caribbean Cruises Limited 5.50% 31/08/2026	77.541	0,06	
USD	142.000	Seagate HDD Cayman 8.25% 15/12/2029	146.103	0,12	USD	345.000	Royal Caribbean Cruises Limited 7.25% 15/01/2030	342.731	0,28	
USD	157.000	Seagate HDD Cayman 8.50% 15/07/2031	161.457	0,13	Total de Liberia			811.849	0,66	
USD	221.000	Transocean Aquila Limited 8.00% 30/09/2028	221.157	0,18	LUXEMBURGO					
USD	282.000	Transocean Titan Financing Limited 8.38% 01/02/2028	287.813	0,23	USD	284.000	Altice France Holding SA 6.00% 15/02/2028	140.580	0,11	
Total de Islas Caimán				1.367.479	1,10	USD	280.000	Axalta Coating Systems LLC 4.75% 15/06/2027	260.776	0,21
					USD	319.000	Camelot Finance SA 4.50% 01/11/2026	295.294	0,24	
					USD	331.000	Fage International 5.63% 15/08/2026	320.660	0,26	
					USD	440.000	Ion Trading Technologies Sarl 5.75% 15/05/2028	384.230	0,31	
					Total de Luxemburgo			1.401.540	1,13	

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
PAÍSES BAJOS				ESTADOS UNIDOS (continuación)					
USD	187.000	Clear Channel International BV 6.63% 01/08/2025	185.426	0,15	USD	452.000	Albertsons Companies Inc. 5.88% 15/02/2028	436.001	0,35
Total de Países Bajos			185.426	0,15	USD	235.000	Alliant Holdings Intermediate LLC 4.25% 15/10/2027	210.619	0,17
PANAMÁ				USD 268.000 Alliant Holdings Intermediate LLC 5.88% 01/11/2029 233.332 0,19					
USD	411.000	Carnival Corp. 4.00% 01/08/2028	357.843	0,29	USD	489.000	Alliant Holdings Intermediate LLC 6.75% 15/10/2027	457.079	0,37
USD	660.000	Carnival Corp. 6.00% 01/05/2029	564.299	0,45	USD	604.000	Alliant Holdings Intermediate LLC 6.75% 15/04/2028	583.647	0,47
USD	110.000	Carnival Corp. 7.00% 15/08/2029	108.744	0,09	USD	881.028	American Airlines Inc. 5.50% 20/04/2026	861.931	0,70
Total de Panamá			1.030.886	0,83	USD	391.110	American Airlines Inc. 5.75% 20/04/2029	363.488	0,29
SUPRANACIONAL				USD 71.000 American Builders & Contractors Supply Company Inc. 3.88% 15/11/2029 59.387 0,05					
USD	319.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 6.00% 15/06/2027	307.217	0,25	USD	316.000	American Builders & Contractors Supply Company Inc. 4.00% 15/01/2028	281.488	0,23
USD	207.000	Clarios Global LP 6.25% 15/05/2026	202.474	0,16	USD	512.000	Arches Buyer Inc. 4.25% 01/06/2028	437.184	0,35
USD	350.000	Clarios Global LP 8.50% 15/05/2027	348.128	0,29	USD	559.000	Arches Buyer Inc. 6.13% 01/12/2028	455.306	0,37
Total de supranacional			857.819	0,70	USD	257.000	Archrock Partners LP Archrock Partners Finance Corp. 6.25% 01/04/2028	241.673	0,20
REINO UNIDO				USD 817.000 Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 4.00% 01/09/2029 640.919 0,52					
USD	215.000	International Game Technology plc 4.13% 15/04/2026	202.329	0,16	USD	165.000	Asbury Automotive Group Inc. 4.63% 15/11/2029	142.111	0,11
USD	140.000	International Game Technology plc P.P. 144A 6.50% 15/02/2025	139.889	0,11	USD	262.000	Asbury Automotive Group Inc. 5.00% 15/02/2032	217.895	0,18
USD	293.000	Virgin Media Finance plc 5.00% 15/07/2030	231.287	0,19	USD	290.000	AssuredPartners Inc. 5.63% 15/01/2029	251.216	0,20
USD	282.000	Virgin Media Secured Finance plc 4.50% 15/08/2030	231.986	0,19	USD	200.000	AssuredPartners Inc. 7.00% 15/08/2025	198.457	0,16
USD	631.000	Vmed O2 UK Financing 4.25% 31/01/2031	502.828	0,41	USD	557.000	AthenaHealth Group Inc. 6.50% 15/02/2030	466.955	0,38
Total de Reino Unido			1.308.319	1,06	USD	539.000	Avantor Funding Inc. 3.88% 01/11/2029	461.791	0,37
ESTADOS UNIDOS				USD 162.000 Avantor Funding Inc. 4.63% 15/07/2028 147.914 0,12					
USD	354.000	Acadia Healthcare Company Inc. 5.00% 15/04/2029	319.550	0,26	USD	279.000	Avient Corp. 7.13% 01/08/2030	274.292	0,22
USD	202.000	Acadia Healthcare Company Inc. 5.50% 01/07/2028	189.165	0,15	USD	180.000	Axalta Coating Systems LLC 3.38% 15/02/2029	150.476	0,12
USD	60.000	Acushnet Co. 7.38% 15/10/2028	60.525	0,05	USD	457.000	Bath & Body Works Inc. 6.63% 01/10/2030	429.638	0,34
USD	396.000	AdaptHealth LLC 5.13% 01/03/2030	309.282	0,25					
USD	390.000	AG TTMT Escrow Issuer LLC 8.63% 30/09/2027	394.410	0,32					
USD	353.000	Albertsons Companies Inc. 3.25% 15/03/2026	327.374	0,26					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
ESTADOS UNIDOS (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)					
USD	210.000	Beacon Roofing Supply Inc. 4.13% 15/05/2029	179.681	0,14	USD	272.000	Cedar Fair LP Canada's Wonderland Company 6.50% 01/10/2028	259.153	0,21
USD	196.000	Beacon Roofing Supply Inc. 4.50% 15/11/2026	184.334	0,15	USD	142.000	Central Parent Inc. 7.25% 15/06/2029	137.655	0,11
USD	314.000	Beacon Roofing Supply Inc. 6.50% 01/08/2030	304.482	0,25	USD	53.000	Central Parent LLC 8.00% 15/06/2029	53.047	0,04
USD	334.000	Black Knight Infoserv LLC 3.63% 01/09/2028	300.542	0,24	USD	159.000	Charles River Laboratories International Inc. 3.75% 15/03/2029	137.232	0,11
USD	346.000	Blackstone Mortgage Trust Inc. 3.75% 15/01/2027	291.763	0,24	USD	161.000	Charles River Laboratories International Inc. 4.25% 01/05/2028	144.907	0,12
USD	275.000	Boyd Gaming Corp. 4.75% 15/06/2031	234.398	0,19	USD	197.000	Chart Industries Inc. 7.50% 01/01/2030	198.231	0,16
USD	350.000	BroadStreet Partners Inc. 5.88% 15/04/2029	309.313	0,25	USD	67.000	Chart Industries Inc. 9.50% 01/01/2031	71.250	0,06
USD	291.000	BWX Technologies Inc. 4.13% 30/06/2028	259.110	0,21	USD	896.000	CHS Inc. 5.25% 15/05/2030	682.702	0,54
USD	663.000	Caesars Entertainment Inc. 4.63% 15/10/2029	562.721	0,45	USD	200.000	CHS Inc. 6.88% 15/04/2029	107.170	0,09
USD	529.000	Caesars Entertainment Inc. 6.25% 01/07/2025	522.134	0,43	USD	260.000	Churchill Downs Inc. 6.75% 01/05/2031	246.455	0,20
USD	597.000	Caesars Entertainment Inc. 7.00% 15/02/2030	581.746	0,48	USD	101.000	Cinemark USA Inc. 5.25% 15/07/2028	89.764	0,07
USD	453.000	Caesars Entertainment Inc. 8.13% 01/07/2027	455.987	0,37	USD	537.000	Cinemark USA Inc. 5.88% 15/03/2026	517.534	0,42
USD	622.000	Callon Petroleum Company 6.38% 01/07/2026	612.910	0,49	USD	188.000	Cinemark USA Inc. 8.75% 01/05/2025	190.210	0,15
USD	190.000	Callon Petroleum Company 7.50% 15/06/2030	184.853	0,15	USD	372.000	Clarivate Science Holdings Corp. 3.88% 01/07/2028	323.218	0,26
USD	280.000	Carnival Holdings Bermuda Limited 10.38% 01/05/2028	300.572	0,24	USD	531.000	Clarivate Science Holdings Corp. 4.88% 01/07/2029	451.212	0,36
USD	204.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 3.13% 15/02/2029	168.379	0,14	USD	177.000	Clear Channel Outdoor Holdings Inc. 7.50% 01/06/2029	135.626	0,11
USD	653.000	CCO Holdings LLC 5.13% 01/05/2027	608.906	0,50	USD	521.000	Clear Channel Worldwide 7.75% 15/04/2028	416.846	0,34
USD	438.000	Cco Holdings LLC 4.25% 01/02/2031	350.488	0,28	USD	561.000	Clear Channel Worldwide Holdings Inc. 5.13% 15/08/2027	498.589	0,40
USD	341.000	CCO Holdings LLC 4.50% 01/05/2032	268.111	0,22	USD	587.000	Clearway Energy Operating LLC 3.75% 15/02/2031	463.730	0,37
USD	755.000	CCO Holdings LLC 4.75% 01/03/2030	636.771	0,50	USD	173.000	Clearway Energy Operating LLC 3.75% 15/01/2032	134.807	0,11
USD	428.000	CCO Holdings LLC 4.75% 01/02/2032	342.668	0,28	USD	290.000	Clearway Energy Operating LLC 4.75% 15/03/2028	259.875	0,21
USD	479.000	CCO Holdings LLC 5.00% 01/02/2028	436.300	0,35	USD	677.000	Cloud Software Group Holdings Inc. 6.50% 31/03/2029	599.991	0,49
USD	678.000	CD&R Smokey Buyer Inc. 6.75% 15/07/2025	654.592	0,52	USD	685.000	Cloud Software Group Inc. 9.00% 30/09/2029	596.506	0,49
USD	244.000	Cedar Fair LP Canada's Wonderland Company 5.50% 01/05/2025	239.425	0,19	USD	317.000	CNX Midstream Partners LP 4.75% 15/04/2030	265.796	0,21

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)			
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)			
ESTADOS UNIDOS (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
USD	317.000 Cnx Resources Corp. 6.00% 15/01/2029	296.059	0,24	USD	118.000 EQM Midstream Partners LP 7.50% 01/06/2027	118.516	0,10
USD	60.000 CNX Resources Corp. 7.38% 15/01/2031	59.016	0,05	USD	281.000 Fertitta Entertainment LLC 6.75% 15/01/2030	229.919	0,19
USD	138.000 CommScope Technologies LLC P.P. 144A 6.00% 15/06/2025	131.704	0,11	USD	270.000 Frontier Communications Holdings LLC 8.63% 15/03/2031	254.874	0,21
USD	763.000 Crownrock LP 5.63% 15/10/2025	752.259	0,61	USD	214.000 Frontier Communications Holdings LLC 8.75% 15/05/2030	203.727	0,16
USD	274.000 CrownRock LP 5.00% 01/05/2029	257.560	0,21	USD	735.000 Gates Global LLC 6.25% 15/01/2026	720.843	0,58
USD	304.000 CSC Holdings LLC 3.38% 15/02/2031	208.293	0,17	USD	628.000 GoTo Group Inc 5.50% 01/09/2027	349.933	0,28
USD	420.000 CSC Holdings LLC 4.13% 01/12/2030	298.725	0,24	USD	275.000 Group 1 Automotive Inc. 4.00% 15/08/2028	239.215	0,19
USD	319.000 CSC Holdings LLC 4.63% 01/12/2030	170.054	0,14	USD	82.000 GTCR AP Finance Inc. 8.00% 15/05/2027	80.701	0,07
USD	218.000 CSC Holdings LLC 5.00% 15/11/2031	117.201	0,09	USD	478.000 GTCR W-2 Merger Sub LLC 7.50% 15/01/2031	478.896	0,39
USD	131.000 CSC Holdings LLC 5.38% 01/02/2028	106.504	0,09	USD	571.000 H&E Equipment Services Inc. 3.88% 15/12/2028	490.389	0,39
USD	403.000 CSC Holdings LLC 6.50% 01/02/2029	334.289	0,27	USD	349.000 Hanesbrands Inc. 9.00% 15/02/2031	331.760	0,27
USD	189.000 Delek Logistics Partners LP 6.75% 15/05/2025	185.220	0,15	USD	486.000 Helios Software Holdings Inc. 4.63% 01/05/2028	423.063	0,34
USD	637.000 DISH DBS Corp. 5.13% 01/06/2029	353.538	0,29	USD	307.000 Herc Holdings Inc. 5.50% 15/07/2027	289.857	0,23
USD	524.000 DISH DBS Corp. 5.75% 01/12/2028	403.807	0,33	USD	277.000 Hightower Holding LLC 6.75% 15/04/2029	238.047	0,19
USD	243.000 DISH DBS Corp. 7.75% 01/07/2026	182.858	0,15	USD	283.000 Hilcorp Energy I LP 5.75% 01/02/2029	256.462	0,21
USD	741.000 DISH Network Corp. 11.75% 15/11/2027	745.060	0,59	USD	152.000 Hilcorp Energy I LP 6.00% 15/04/2030	137.019	0,11
USD	535.000 DT Midstream Inc. 4.13% 15/06/2029	463.778	0,37	USD	197.000 Hilcorp Energy I LP 6.25% 01/11/2028	185.303	0,15
USD	207.000 DT Midstream Inc. 4.38% 15/06/2031	174.203	0,14	USD	237.000 Hilcorp Energy I LP 6.25% 15/04/2032	210.881	0,17
USD	419.000 Element Solutions Inc. 3.88% 01/09/2028	362.772	0,29	USD	242.000 Holly Energy Partners Corp. 5.00% 01/02/2028	223.509	0,18
USD	412.000 Emerald Debt Merger Sub LLC 6.63% 15/12/2030	397.593	0,32	USD	188.000 Holly Energy Partners Corp. 6.38% 15/04/2027	184.828	0,15
USD	330.000 Endeavor Energy Resources LP 5.75% 30/01/2028	320.053	0,26	USD	343.000 HUB International Limited 5.63% 01/12/2029	300.535	0,24
USD	623.000 Entegris Escrow Corp. 5.95% 15/06/2030	578.866	0,46	USD	494.000 HUB International Limited 7.00% 01/05/2026	493.367	0,40
USD	227.000 EQM Midstream Partner LP 4.50% 15/01/2029	202.236	0,16	USD	435.000 HUB International Limited 7.25% 15/06/2030	434.772	0,35
USD	369.000 EQM Midstream Partner LP 6.00% 01/07/2025	364.081	0,29	USD	391.000 iHeartCommunications 4.75% 15/01/2028	297.991	0,24
USD	125.000 EQM Midstream Partner LP 6.50% 01/07/2027	122.266	0,10	USD	282.000 iHeartCommunications Inc. 5.25% 15/08/2027	223.640	0,18
USD	422.000 EQM Midstream Partners LP 4.75% 15/01/2031	364.294	0,29				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
ESTADOS UNIDOS (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)					
USD	608.757	iHeartCommunications Inc. 8.38% 01/05/2027	438.254	0,36	USD	418.000	Matador Resources Company 5.88% 15/09/2026	403.757	0,33
USD	196.000	Illuminate Buyer LLC 9.00% 01/07/2028	186.078	0,15	USD	147.000	Matador Resources Company 6.88% 15/04/2028	144.821	0,12
USD	329.000	Ingevity Corp. 3.88% 01/11/2028	271.014	0,22	USD	115.000	Match Group Holdings II LLC 3.63% 01/10/2031	90.681	0,07
USD	357.000	Innophos Holdings Inc. 9.38% 15/02/2028	344.146	0,28	USD	463.000	Match Group Holdings II LLC 4.63% 01/06/2028	417.096	0,34
USD	171.000	Interface Inc. 5.50% 01/12/2028	145.991	0,12	USD	753.000	McAfee Corp. 7.38% 15/02/2030	632.316	0,51
USD	121.000	IQVIA Inc. 6.50% 15/05/2030	118.973	0,10	USD	141.000	Medline Borrower LP 3.88% 01/04/2029	119.366	0,10
USD	344.000	IRB Holding Corp 7.00% 15/06/2025	344.215	0,28	USD	800.000	Medline Borrower LP 5.25% 01/10/2029	692.294	0,56
USD	219.000	Iris Holdings Inc. 8.75% 15/02/2026	197.921	0,16	USD	416.000	Meritage Homes Corp. 3.88% 15/04/2029	358.116	0,29
USD	237.000	Iron Mountain Inc. 5.00% 15/07/2028	216.328	0,17	USD	214.000	Midwest Gaming Borrower LLC 4.88% 01/05/2029	182.569	0,15
USD	414.000	Iron Mountain Inc. 5.25% 15/03/2028	382.916	0,31	USD	355.852	Mileage Plus Holdings LLC 6.50% 20/06/2027	353.389	0,29
USD	145.000	ITT Holdings LLC 6.50% 01/08/2029	123.889	0,10	USD	170.000	Nabors Industries Inc. 7.38% 15/05/2027	165.181	0,13
USD	184.000	Kaiser Aluminum Corp. 4.50% 01/06/2031	145.862	0,12	USD	420.000	NCR Atleos Escrow Corp. 9.50% 01/04/2029	406.487	0,33
USD	161.000	Kaiser Aluminum Corp. 4.63% 01/03/2028	141.115	0,11	USD	759.000	NCR Corp. 5.00% 01/10/2028	682.265	0,55
USD	200.000	Ladder Capital Finance Holdings LLP 4.25% 01/02/2027	175.116	0,14	USD	288.000	NCR Corp. 5.13% 15/04/2029	253.902	0,20
USD	772.000	Ladder Capital Finance Holdings LLP 4.75% 15/06/2029	626.268	0,52	USD	175.000	NCR Corp. 5.75% 01/09/2027	176.291	0,14
USD	371.000	Ladder Capital Finance Holdings LLP 5.25% 01/10/2025	358.283	0,29	USD	120.000	NCR Corp. 6.13% 01/09/2029	123.420	0,10
USD	173.000	LCM Investments Holdings II LLC 8.25% 01/08/2031	169.129	0,14	USD	729.000	Neptune Bidco USA Inc. 9.29% 15/04/2029	661.112	0,54
USD	164.000	Light & Wonder International Inc 7.00% 15/05/2028	161.335	0,13	USD	119.000	Newell Brands Inc. 6.38% 15/09/2027	113.935	0,09
USD	66.000	Light & Wonder International Inc. 7.50% 01/09/2031	65.463	0,05	USD	167.000	Newell Brands Inc. 6.63% 15/09/2029	159.652	0,13
USD	141.000	Lithia Motors Inc. 3.88% 01/06/2029	118.881	0,10	USD	107.000	NextEra Energy Operating Partners LP 3.88% 15/10/2026	96.969	0,08
USD	180.000	Lithia Motors Inc. 4.38% 15/01/2031	149.483	0,12	USD	384.000	NextEra Energy Operating Partners LP 4.50% 15/09/2027	348.202	0,28
USD	320.000	Live Nation Entertainment Inc. 4.75% 15/10/2027	293.948	0,24	USD	93.000	NFP Corp 8.50% 01/10/2031	93.186	0,08
USD	229.000	Live Nation Entertainment Inc. 4.88% 01/11/2024	225.854	0,18	USD	267.000	NFP Corp. 4.88% 15/08/2028	235.858	0,19
USD	254.000	Live Nation Entertainment Inc. 6.50% 15/05/2027	250.725	0,20	USD	773.000	NFP Corp. 6.88% 15/08/2028	664.779	0,54
USD	144.000	Madison IAQ LLC 4.13% 30/06/2028	124.767	0,10	USD	342.000	NFP Corp. 7.50% 01/10/2030	329.306	0,27
USD	372.000	Madison IAQ LLC 5.88% 30/06/2029	299.925	0,24	USD	287.000	Novelis Corp. 3.25% 15/11/2026	257.216	0,21
					USD	758.000	Novelis Corp. 4.75% 30/01/2030	658.247	0,53
					USD	460.000	NRG Energy Inc. 3.63% 15/02/2031	349.478	0,28
					USD	247.000	NRG Energy Inc. 5.25% 15/06/2029	218.805	0,18
					USD	379.000	Olympus Water US Holding Corp. 9.75% 15/11/2028	378.763	0,31

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
ESTADOS UNIDOS (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)					
USD	513.000	Olympus Water USA 4.25% 01/10/2028	419.067	0,34	USD	76.000	RHP Hotel Properties LP 7.25% 15/07/2028	75.108	0,06
USD	272.000	Olympus Water USA 6.25% 01/10/2029	212.119	0,17	USD	129.000	RLJ Lodging Trust LP 3.75% 01/07/2026	116.584	0,09
USD	260.000	Olympus Water USA Holding Corp. 7.13% 01/10/2027	242.492	0,20	USD	569.000	Roblox Corp. 3.88% 01/05/2030	458.152	0,37
USD	167.000	OPENLANE Inc. 5.13% 01/06/2025	162.115	0,13	USD	330.000	Rocket Mortgage LLC 3.63% 01/03/2029	272.869	0,22
USD	375.000	Organon & Company 4.13% 30/04/2028	326.278	0,26	USD	247.000	Rocket Mortgage LLC 3.88% 01/03/2031	196.983	0,16
USD	433.000	Organon & Company 5.13% 30/04/2031	348.566	0,29	USD	906.000	Rocket Mortgage LLC 4.00% 15/10/2033	689.786	0,55
USD	196.000	Outfront Media Capital LLC 4.25% 15/01/2029	156.339	0,13	USD	582.000	Scientific Games Holdings LP 6.63% 01/03/2030	502.746	0,41
USD	379.000	Outfront Media Capital LLC 4.63% 15/03/2030	298.501	0,23	USD	80.000	Scotts Miracle-Gro Company 4.00% 01/04/2031	61.628	0,05
USD	80.000	Outfront Media Capital LLC 5.00% 15/08/2027	71.130	0,06	USD	260.000	Scotts Miracle-Gro Company 4.38% 01/02/2032	196.463	0,16
USD	273.000	Park Intermediate Holdings LLC 4.88% 15/05/2029	232.596	0,19	USD	622.000	Select Medical Corp. 6.25% 15/08/2026	607.371	0,49
USD	395.000	Park Intermediate Holdings LLC 5.88% 01/10/2028	360.861	0,29	USD	362.000	Shift4 Payments LLC 4.63% 01/11/2026	341.638	0,28
USD	77.000	Park Intermediate Holdings LLC 7.50% 01/06/2025	76.981	0,06	USD	456.000	Simmons Food Inc. 4.63% 01/03/2029	375.501	0,30
USD	744.000	Permian Resources Operating LLC 5.88% 01/07/2029	701.684	0,57	USD	208.000	Sirius XM Radio Inc. 3.13% 01/09/2026	185.760	0,15
USD	73.000	Permian Resources Operating LLC 6.88% 01/04/2027	72.179	0,06	USD	346.000	Sirius XM Radio Inc. 4.00% 15/07/2028	295.371	0,24
USD	329.000	Permian Resources Operating LLC 7.00% 15/01/2032	324.682	0,26	USD	58.000	Sirius XM Radio Inc. 5.00% 01/08/2027	53.086	0,04
USD	348.000	PetSmart Inc. 4.75% 15/02/2028	305.187	0,25	USD	174.000	Sirius XM Radio Inc. 5.50% 01/07/2029	154.280	0,12
USD	408.000	PetSmart Inc. 7.75% 15/02/2029	380.919	0,31	USD	438.000	Six Flags Entertainment Corp. 7.25% 15/05/2031	412.268	0,33
USD	447.000	Pilgrim's Pride Corp. 3.50% 01/03/2032	346.150	0,28	USD	206.000	Southwestern Energy Company 5.38% 01/02/2029	189.842	0,15
USD	640.000	Post Holdings Inc. 4.63% 15/04/2030	549.641	0,45	USD	199.000	Spectrum Brands Inc. 5.00% 01/10/2029	179.870	0,15
USD	104.000	Post Holdings Inc. 5.63% 15/01/2028	98.358	0,08	USD	123.000	Spectrum Brands Inc. 5.50% 15/07/2030	112.276	0,09
USD	340.000	Post Holdings Inc. 5.75% 01/03/2027	326.825	0,26	USD	200.000	Spirit AeroSystems Inc. 9.38% 30/11/2029	203.750	0,16
USD	125.000	Prime Security Services Borrower LLC 5.75% 15/04/2026	121.484	0,10	USD	133.000	SRS Distribution Inc. 4.63% 01/07/2028	115.754	0,09
USD	628.000	Provident Funding Associates LP 6.38% 15/06/2025	563.179	0,45	USD	340.000	SRS Distribution Inc. 6.00% 01/12/2029	288.074	0,23
USD	407.000	Radiate Holco LLC 4.50% 15/09/2026	311.675	0,25	USD	519.000	SRS Distribution Inc. 6.13% 01/07/2029	445.137	0,35
USD	82.000	Radiate Holco LLC 6.50% 15/09/2028	43.247	0,03	USD	258.000	Standard Industries Inc. 5.00% 15/02/2027	239.899	0,19
USD	365.000	Resideo Funding Inc. 4.00% 01/09/2029	300.304	0,24					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
ESTADOS UNIDOS (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)					
USD	176.000	Star Parent Inc. 9.00% 01/10/2030	178.068	0,14	USD	146.000	US Foods Inc. 7.25% 15/01/2032	145.944	0,12
USD	244.000	Sunoco LP Sunoco Finance Corp. 5.88% 15/03/2028	234.965	0,19	USD	317.000	USA Compression Partners LP 6.88% 01/04/2026	311.967	0,25
USD	210.000	Surgery Center Holdings Inc. 6.75% 01/07/2025	208.945	0,17	USD	335.000	USI Inc. 6.88% 01/05/2025	334.370	0,27
USD	84.000	Synaptics Inc. 4.00% 15/06/2029	69.983	0,06	USD	376.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC 3.88% 15/08/2029	318.096	0,26
USD	200.000	Taylor Morrison Communities Inc. 5.75% 15/01/2028	186.675	0,15	USD	612.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC 3.88% 01/11/2033	475.830	0,38
USD	168.000	Taylor Morrison Communities Inc. 5.88% 15/06/2027	160.583	0,13	USD	363.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC 4.13% 15/08/2031	298.322	0,24
USD	215.000	Tempo Acquisition LLC 5.75% 01/06/2025	210.787	0,17	USD	326.000	Venture Global LNG Inc. 8.13% 01/06/2028	322.944	0,26
USD	415.000	Tenet Healthcare Corp. 4.88% 01/01/2026	398.141	0,32	USD	238.000	Venture Global LNG Inc. 8.38% 01/06/2031	233.984	0,19
USD	275.000	Tenet Healthcare Corp. 5.13% 01/11/2027	256.211	0,21	USD	436.000	Verscend Escrow Corp. 9.75% 15/08/2026	436.667	0,35
USD	309.000	Tenet Healthcare Corp. 6.13% 01/10/2028	290.398	0,23	USD	222.000	Vistra Operations Company LLC 5.50% 01/09/2026	211.696	0,17
USD	736.000	Tenet Healthcare Corp. 6.25% 01/02/2027	713.497	0,57	USD	457.000	Vistra Operations Company LLC 5.63% 15/02/2027	433.538	0,35
USD	254.000	Tenet Healthcare Corp. 6.75% 15/05/2031	245.428	0,20	USD	315.000	Vistra Operations Company LLC 7.75% 15/10/2031	310.573	0,25
USD	34.000	Terraform Power Operating LLC 4.75% 15/01/2030	29.013	0,02	USD	537.000	Waste Pro USA Inc. 5.50% 15/02/2026	502.095	0,41
USD	277.000	Terraform Power Operating LLC 5.00% 31/01/2028	251.724	0,20	USD	233.000	Wesco Distribution Inc. 7.13% 15/06/2025	233.856	0,19
USD	644.000	TK Elevator Holdco GmbH 5.25% 15/07/2027	591.275	0,48	USD	635.000	Wesco Distribution Inc. 7.25% 15/06/2028	639.879	0,51
USD	981.000	TransDigm Inc. 6.25% 15/03/2026	964.804	0,79	USD	619.000	White Cap Buyer LLC 6.88% 15/10/2028	550.447	0,44
USD	605.000	TransDigm Inc. 6.75% 15/08/2028	596.368	0,48	USD	401.000	Wolverine World Wide Inc. 4.00% 15/08/2029	297.241	0,24
USD	308.000	TransDigm Inc. 6.88% 15/12/2030	301.997	0,24	USD	489.000	WR Grace Holdings LLC 4.88% 15/06/2027	449.618	0,36
USD	619.000	Transmontaigne Partners LP 6.13% 15/02/2026	531.513	0,44	USD	852.000	WR Grace Holdings LLC 5.63% 15/08/2029	689.034	0,56
USD	899.000	Uber Technologies Inc. 4.50% 15/08/2029	805.869	0,65	USD	245.000	WR Grace Holdings LLC 7.38% 01/03/2031	237.792	0,19
USD	457.000	United Airlines Inc. 4.38% 15/04/2026	424.553	0,34	USD	155.000	ZF North America Capital Inc. 7.13% 14/04/2030	152.140	0,12
USD	279.000	Univision Communications Inc. 4.50% 01/05/2029	227.726	0,18	USD	690.000	ZoomInfo Technologies LLC 3.88% 01/02/2029	575.719	0,46
USD	235.000	Univision Communications Inc. 7.38% 30/06/2030	214.925	0,17					
USD	59.000	Univision Communications Inc. 8.00% 15/08/2028	57.026	0,05			Total de Estados Unidos	87.859.974	70,91
USD	162.000	US Foods Inc. 4.63% 01/06/2030	141.113	0,11			Total de bonos	102.145.860	82,43
USD	399.000	US Foods Inc. 4.75% 15/02/2029	358.641	0,28			Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente	102.145.860	82,43
USD	157.000	US Foods Inc. 6.88% 15/09/2028	156.768	0,13					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario			
Bonos			
LUXEMBURGO			
USD 142.000	Altice France Holding SA 10.50% 15/05/2027	88.839	0,07
	Total de Luxemburgo	88.839	0,07
PAÍSES BAJOS			
USD 300.000	VZ Secured Financing BV 5.00% 15/01/2032	235.824	0,19
	Total de Países Bajos	235.824	0,19
ESTADOS UNIDOS			
USD 147.000	NRG Energy Inc. 3.38% 15/02/2029	119.397	0,10
	Total de Estados Unidos	119.397	0,10
	Total de bonos	444.060	0,36
	Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario	444.060	0,36
	Valor total de las inversiones	119.016.604	96,03
	(Coste total: 131.187.966 USD)		

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2023

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos				Bonos (continuación)					
BAHAMAS				ISLAS CAIMÁN (continuación)					
USD	200.000	Competition Team Technologies Limited 3.75% 12/03/2024	197.777	0,56	USD	467.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp. 1.63% 24/09/2025	429.591	1,22
Total de Bahamas			197.777	0,56	Total de Islas Caimán			5.283.215	15,07
ISLAS CAIMÁN				HONG KONG					
USD	500.000	AAC Technologies Holdings Inc. 3.75% 02/06/2031	346.556	0,99	USD	400.000	Bank of East Asia Limited FRN 29/05/2030	367.793	1,05
USD	250.000	Alibaba Group Holding Limited 4.50% 28/11/2034	217.320	0,62	USD	260.000	Lenovo Group Limited 3.42% 02/11/2030	213.092	0,61
USD	500.000	China Mengniu Dairy Company Limited 1.88% 17/06/2025	466.371	1,33	USD	200.000	Lenovo Group Limited 6.54% 27/07/2032	197.964	0,56
USD	600.000	CK Hutchison International 17 II Limited 3.25% 29/09/2027	549.590	1,57	USD	500.000	Xiaomi Best Time International Limited 2.88% 14/07/2031	372.809	1,06
USD	200.000	Country Garden Holdings Company Limited 2.70% 12/07/2026	13.346	0,04	Total de Hong Kong			1.151.658	3,28
USD	460.000	Country Garden Holdings Company Limited 3.13% 22/10/2025	31.106	0,09	INDIA				
USD	200.000	Country Garden Holdings Company Limited 5.40% 27/05/2025	13.830	0,04	USD	200.000	Adani Electricity Mumbai Limited 3.95% 12/02/2030	147.814	0,42
USD	500.000	ENN Energy Holdings Limited 2.63% 17/09/2030	402.455	1,15	USD	300.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 3.10% 02/02/2031	208.310	0,59
USD	400.000	Goodman HK Finance 3.00% 22/07/2030	326.313	0,92	USD	200.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 3.83% 02/02/2032	141.918	0,40
USD	500.000	HPHT Finance 19 Limited 2.88% 05/11/2024	483.253	1,38	USD	200.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029	160.207	0,46
USD	200.000	Longfor Group Holdings Limited 3.95% 16/09/2029	96.718	0,28	USD	400.000	GMR Hyderabad International Airport 4.25% 27/10/2027	357.245	1,02
USD	200.000	Longfor Group Holdings Limited 4.50% 16/01/2028	112.186	0,32	USD	226.000	GMR Hyderabad International Airport 4.75% 02/02/2026	213.950	0,61
USD	600.000	Meituan 3.05% 28/10/2030	466.886	1,33	USD	500.000	Indian Railway Finance Corp. Limited 2.80% 10/02/2031	402.265	1,15
USD	300.000	Melco Resorts Finance Limited 5.38% 04/12/2029	248.828	0,71	USD	300.000	JSW Steel Limited 5.05% 05/04/2032	242.197	0,69
USD	300.000	MGM China Holdings Limited 4.75% 01/02/2027	270.375	0,77	USD	500.000	ONGC Videsh Limited 4.63% 15/07/2024	493.415	1,41
USD	250.000	Sun Hung Kai Properties Capital Market Limited 2.75% 13/05/2030	207.290	0,59	USD	700.000	Reliance Industries Limited 3.63% 12/01/2052	449.561	1,28
USD	270.000	Sun Hung Kai Properties Capital Market Limited 3.75% 25/02/2029	244.967	0,70	USD	490.000	ReNew Wind Energy AP2 4.50% 14/07/2028	410.649	1,17
USD	200.000	Sunac China Holdings Limited 6.50% 09/07/2024	31.308	0,09	Total de India			3.227.531	9,20
USD	400.000	Tencent Holdings Limited 2.88% 22/04/2031	324.926	0,93					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
INDONESIA				FILIPINAS					
USD	600.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 5.80% 15/05/2050	487.537	1,39	USD	400.000	Globe Telecom Inc. 2.50% 23/07/2030	319.306	0,91
USD	600.000	Pertamina Persero PT 5.63% 20/05/2043	524.263	1,49	USD	520.000	Globe Telecom Inc. - Perp FRN	484.064	1,38
USD	200.000	Perusahaan Perseroan Persero PT 5.25% 24/10/2042	163.550	0,47	USD	200.000	International Container Terminal SE 4.75% 17/06/2030	188.540	0,54
USD	200.000	Perusahaan Perseroan Persero PT 6.25% 25/01/2049	180.692	0,52	USD	670.000	Smc Global Power Holdings Corp. - Perp FRN	482.857	1,38
USD	400.000	Sri Rejeki Isman TBK PT 7.25% 16/01/2025	13.100	0,04			Total de Filipinas	1.474.767	4,21
		Total de Indonesia	1.369.142	3,91					
ISLA DE MAN				REPÚBLICA DE COREA (SUR)					
USD	400.000	Gohl Capital Limited 4.25% 24/01/2027	369.444	1,05	USD	368.000	LG Energy Solution Limited 5.63% 25/09/2026	366.655	1,05
		Total de Isla de Man	369.444	1,05	USD	600.000	SK Hynix Inc. 6.50% 17/01/2033	590.799	1,68
MALASIA				SINGAPUR					
USD	200.000	Axiata SPV2 Bhd 4.36% 24/03/2026	193.096	0,55	USD	300.000	ABJA Investment Company 5.45% 24/01/2028	293.138	0,84
USD	500.000	Petronas Capital Limited 3.50% 21/04/2030	443.051	1,26	USD	400.000	BOC Aviation Limited 2.63% 17/09/2030	327.391	0,94
USD	720.000	Petronas Capital Limited 4.55% 21/04/2050	587.764	1,68	USD	550.000	DBS Group Holdings Limited FRN 11/12/2028	548.248	1,56
USD	400.000	TNB Global Ventures Capital Bhd 4.85% 01/11/2028	387.292	1,10	USD	700.000	SingTel Group Treasury Pte Limited 1.88% 10/06/2030	562.670	1,61
		Total de Malasia	1.611.203	4,59	USD	550.000	United Overseas Bank Limited FRN 16/03/2031	495.344	1,41
MAURICIO				TAILANDIA					
USD	400.000	Greenko Solar Mauritius Limited 5.55% 29/01/2025	387.043	1,10	USD	800.000	Bangkok Bank plc FRN 25/09/2034	669.194	1,90
		Total de Mauricio	387.043	1,10	USD	270.000	GC Treasury Center Company Limited 4.30% 18/03/2051	178.183	0,51
PAÍSES BAJOS				REINO UNIDO					
USD	518.000	Greenko Dutch BV 3.85% 29/03/2026	468.411	1,34	USD	200.000	GC Treasury Centre Company 2.98% 18/03/2031	158.291	0,45
USD	250.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	227.189	0,65	USD	400.000	Kasikornbank plc FRN 02/10/2031	356.690	1,02
USD	500.000	Royal Capital BV - Perp FRN	485.288	1,38			Total de Tailandia	1.362.358	3,88
		Total de Países Bajos	1.180.888	3,37					
					USD	600.000	Standard Chartered plc - Perp FRN	573.780	1,64
					USD	400.000	Vedanta Resources plc 6.13% 09/08/2024	255.252	0,73
							Total de Reino Unido	829.032	2,37

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)					
ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)				INDONESIA (continuación)					
USD	200.000	Champion Path Holding 4.85% 27/01/2028	161.453	0,46	USD	200.000	Indonesia (Govt of) 6.63% 17/02/2037	213.378	0,61
USD	500.000	CMHI Finance Company - Perp FRN	499.478	1,42	USD	200.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 2.30% 23/06/2025	188.752	0,54
USD	500.000	CNPC Global Capital Limited 1.35% 23/06/2025	463.810	1,32	Total de Indonesia			2.466.033	7,03
USD	600.000	Elect Global Investments Limited - Perp FRN	493.118	1,40	MONGOLIA				
USD	750.000	FPC Resources Limited 4.38% 11/09/2027	717.375	2,05	USD	200.000	Mongolia (Govt of) 8.65% 19/01/2028	199.192	0,57
USD	511.000	HKT Capital No 5 Limited 3.25% 30/09/2029	446.641	1,27	Total de Mongolia			199.192	0,57
USD	500.000	Hongkong Electric Finance Limited 1.88% 27/08/2030	394.263	1,12	PAKISTÁN				
USD	1.000.000	Jgsh Philippines Limited 4.13% 09/07/2030	903.154	2,57	USD	350.000	Pakistan (Govt of) 6.00% 08/04/2026	183.180	0,52
USD	300.000	Nan Fung Treasury Limited 5.00% 05/09/2028	275.047	0,78	USD	200.000	Pakistan (Govt of) 8.25% 30/09/2025	124.050	0,35
USD	340.000	State Grid Overseas Investment 2016 Limited 1.63% 05/08/2030	271.338	0,77	Total de Pakistán			307.230	0,87
USD	500.000	Studio City Finance Limited 5.00% 15/01/2029	377.692	1,08	FILIPINAS				
USD	400.000	Studio City Finance Limited 6.00% 15/07/2025	378.790	1,08	USD	1.000.000	Philippine (Govt of) 3.70% 02/02/2042	746.513	2,13
USD	850.000	TSMC Global Limited 0.75% 28/09/2025	771.324	2,20	USD	400.000	Philippine (Govt of) 3.75% 14/01/2029	370.780	1,06
USD	400.000	Yongda Investment Limited 2.25% 16/06/2025	374.928	1,07	Total de Filipinas			1.117.293	3,19
Total de Islas Vírgenes (Británicas)			6.528.411	18,59	SRI LANKA				
Total de bonos			28.156.714	80,27	USD	420.000	Sri Lanka (Govt of) 5.75% 18/04/2024	202.307	0,58
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				Total de Sri Lanka				202.307	0,58
INDIA				ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)					
USD	400.000	Export-Import Bank of India 3.25% 15/01/2030	341.363	0,97	USD	500.000	Talent Yield International Limited 3.13% 06/05/2031	416.634	1,19
Total de India			341.363	0,97	Total de Islas Vírgenes (Británicas)			416.634	1,19
INDONESIA				Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda					
USD	800.000	Indonesia (Govt of) 3.40% 18/09/2029	714.057	2,04	5.050.052			14,40	
USD	1.000.000	Indonesia (Govt of) 4.75% 11/02/2029	965.039	2,74	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				
IDR	6.100.000.000	Indonesia (Govt of) 6.38% 15/04/2032	384.807	1,10	33.206.766			94,67	

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario			
Bonos			
ISLAS CAIMÁN			
USD	600.000	CIFI Holdings Group Company Limited 0.00% 16/07/2025	42.595 0,12
USD	1.000.000	Logan Group Company Limited 0.00% 06/07/2026	70.220 0,19
USD	450.000	Sunac China Holdings Limited 8.35% 19/04/2024	70.200 0,20
USD	600.000	Times China Holdings Limited 0.00% 16/07/2024	23.448 0,07
	Total de Islas Caimán	206.463	0,58
Total de bonos		206.463	0,58
Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario		206.463	0,58
Valor total de las inversiones		33.413.229	95,25
(Coste total: 41.517.197 USD)			

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Renta variable (continuación)				Renta variable (continuación)				
NORUEGA				ESTADOS UNIDOS (continuación)				
6.643	Equinor ASA	219.219	0,69	618	Intuit Inc.	315.760	0,99	
	Total de Noruega	219.219	0,69	2.099	JPMorgan Chase & Company	304.397	0,96	
SINGAPUR				284	Lam Research Corp.	178.003	0,56	
12.200	DBS Group Holdings Limited	300.687	0,95	3.665	Marvell Technology Inc.	198.386	0,63	
	Total de Singapur	300.687	0,95	1.582	Mastercard Inc. - A	626.330	1,99	
SUIZA				134	Mercadolibre Inc.	169.896	0,54	
1.135	DSM-Firmenich AG	96.291	0,31	4.636	Micron Technology Inc.	315.387	1,00	
332	Lonza Group AG - Reg	154.459	0,49	3.503	Microsoft Corp.	1.106.071	3,50	
2.647	Nestle SA - Reg	300.175	0,95	3.102	NextEra Energy Inc.	177.714	0,56	
	Total de Suiza	550.925	1,75	1.253	Nvidia Corp.	545.042	1,73	
TAIWÁN				1.803	ON Semiconductor Corp.	167.589	0,53	
23.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	372.634	1,18	1.576	PepsiCo Inc.	267.038	0,85	
	Total de Taiwán	372.634	1,18	2.187	Qualcomm Inc.	242.888	0,77	
REINO UNIDO				488	Thermo Fisher Scientific Inc.	247.010	0,79	
3.965	Anglo American plc	109.638	0,35	3.416	T-Mobile USA Inc.	478.411	1,52	
2.699	Ashtead Group plc	164.779	0,52	4.539	Trimble Inc.	244.471	0,77	
5.402	Diageo plc	200.044	0,63	6.169	Uber Technologies Inc.	283.712	0,90	
11.165	Shell plc	355.131	1,13	1.390	Union Pacific Corp.	283.046	0,90	
	Total de Reino Unido	829.592	2,63	1.108	Zoetis Inc.	192.770	0,61	
ESTADOS UNIDOS					Total de Estados Unidos	10.811.277	34,24	
1.703	Abbott Laboratories	164.936	0,52		Total de renta variable	17.555.389	55,63	
415	Adobe Systems Inc.	211.609	0,67		Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	26.407.401	83,68	
1.677	Advanced Micro Devices Inc.	172.429	0,55		Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente			
4.649	Alphabet Inc. - A	608.368	1,93		Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda			
4.983	Amazon.com Inc.	633.439	2,00		ESTADOS UNIDOS			
750	Autodesk Inc.	155.183	0,49	USD	1.460.000	United States Treasury Bill		
370	Cooper Companies Inc.	117.664	0,37			0.00% 16/11/2023	1.450.346	4,60
1.205	CrowdStrike Holdings Inc. - A	201.693	0,64		Total de Estados Unidos		1.450.346	4,60
1.567	Dexcom Inc.	146.201	0,46		Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda		1.450.346	4,60
1.784	Ecolab Inc.	302.210	0,96		Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente		1.450.346	4,60
2.008	Electronic Arts Inc.	241.763	0,77					
830	Elevance Health Inc.	361.398	1,14					
579	Eli Lilly & Company	310.997	0,98					
238	Equinix Inc.	172.850	0,55					
1.378	Hess Corp.	210.834	0,67					
376	Humana Inc.	182.932	0,58					
2.480	IntercontinentalExchange Inc.	272.850	0,86					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
LUXEMBURGO			
40.390	Threadneedle (Lux) - EnhancedCommodities Portfolio XU**	850.827	2,70
	Total de Luxemburgo	850.827	2,70
	Total de fondos	850.827	2,70
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	850.827	2,70
Otros organismos de inversión colectiva			
Fondos			
REINO UNIDO			
USD 540.712	CT Emerging Market LocalFund***	1.505.776	4,77
	Total de Reino Unido	1.505.776	4,77
	Total de fondos	1.505.776	4,77
	Total de otros organismos de inversión colectiva	1.505.776	4,77
	Valor total de las inversiones	30.214.350	95,75
	(Coste total: 27.931.900 USD)		

* Diferencias menores debido al redondeo.

** Consulte la nota 18.

*** Fondo de parte vinculada.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2023

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*				
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)							
Bonos				Bonos (continuación)							
AUSTRALIA				FRANCIA (continuación)							
EUR	100.000	APA Infrastructure Limited 0.75% 15/03/2029	85.942	0,09	EUR	107.000	Casino Guichard Perrachon SA 6.63% 15/01/2026	1.765	0,00		
USD	77.000	Ausgrid Finance Pty Limited 4.35% 01/08/2028	71.949	0,07	EUR	200.000	Electricite de France SA - Perp FRN	174.573	0,18		
EUR	100.000	NBN Company Limited 4.13% 15/03/2029	105.030	0,11	EUR	200.000	Electricite de France SA - Perp FRN	184.863	0,19		
Total de Australia			262.921	0,27	EUR	100.000	Electricite de France SA - Perp FRN	101.364	0,10		
BÉLGICA				EUR				100.000	Electricite de France SA - Perp FRN	103.463	0,11
EUR	100.000	Azelis Finance NV 5.75% 15/03/2028	106.213	0,11	GBP	200.000	Electricite de France SA - Perp FRN	204.493	0,21		
EUR	100.000	Solvay SA - Perp FRN	98.304	0,10	EUR	100.000	Elior Group SA 3.75% 15/07/2026	83.738	0,09		
EUR	100.000	Solvay SA - Perp FRN	105.582	0,11	EUR	100.000	Emeria SASU 7.75% 31/03/2028	98.573	0,10		
Total de Bélgica			310.099	0,32	EUR	150.000	Forvia SE 2.38% 15/06/2027	139.733	0,14		
CANADÁ				EUR				187.000	Forvia SE 2.75% 15/02/2027	178.724	0,18
USD	30.000	Cenovus Energy Inc. 3.75% 15/02/2052	19.772	0,02	EUR	100.000	Forvia SE 7.25% 15/06/2026	109.357	0,11		
USD	31.000	Enbridge Inc. 5.70% 08/03/2033	29.724	0,03	EUR	105.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	108.430	0,11		
EUR	172.000	Primo Water Holdings Inc. 3.88% 31/10/2028	164.619	0,17	EUR	317.000	Iliad Holding SASU 5.13% 15/10/2026	319.826	0,32		
Total de Canadá			214.115	0,22	EUR	100.000	iliad SA 5.38% 14/06/2027	103.141	0,11		
ISLAS CAIMÁN				EUR				100.000	iliad SA 5.63% 15/02/2030	101.030	0,10
GBP	112.000	Southern Water Services Finance Limited 2.38% 28/05/2028	112.876	0,12	EUR	182.000	Loxam SAS 3.25% 14/01/2025	189.567	0,19		
Total de Islas Caimán			112.876	0,12	EUR	160.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	166.681	0,17		
FINLANDIA				EUR				163.000	Parts Europe SA 6.50% 16/07/2025	172.633	0,17
EUR	100.000	OP Corporate Bank plc 0.10% 16/11/2027	90.238	0,09	EUR	100.000	Renault SA 2.38% 25/05/2026	98.323	0,10		
Total de Finlandia			90.238	0,09	EUR	100.000	Renault SA 2.50% 02/06/2027	96.037	0,10		
FRANCIA				EUR				100.000	Rexel SA 2.13% 15/06/2028	93.456	0,10
EUR	100.000	Altice France SA 2.50% 15/01/2025	100.585	0,10	EUR	100.000	Rexel SA 5.25% 15/09/2030	104.823	0,11		
EUR	100.000	Altice France SA 4.00% 15/07/2029	76.262	0,08	EUR	100.000	Valeo SE 5.38% 28/05/2027	105.989	0,11		
EUR	100.000	Altice France SA 4.13% 15/01/2029	77.626	0,08	Total de Francia			3.624.826	3,69		
EUR	104.000	Altice France SA 4.25% 15/10/2029	79.680	0,08	ALEMANIA						
EUR	100.000	BPCE SA 0.25% 14/01/2031	79.810	0,08	EUR	100.000	Amprion GmbH 3.97% 22/09/2032	103.212	0,11		
EUR	192.000	CAB Selas 3.38% 01/02/2028	170.281	0,17	EUR	200.000	Bayer AG FRN 25/03/2082	198.609	0,20		
				EUR				100.000	Bayer AG FRN 25/09/2083	104.839	0,11
				EUR				200.000	Bayer AG FRN 25/09/2083	209.661	0,22
				EUR				130.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.50% 11/02/2027	125.722	0,13
				EUR				101.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 4.38% 15/01/2028	97.767	0,10
				EUR				100.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 7.50% 15/05/2030	106.199	0,11
				EUR				200.000	Commerzbank AG FRN 29/12/2031	176.823	0,18

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
ALEMANIA (continuación)				IRLANDA (continuación)					
USD	150.000	Deutsche Bank AG FRN 28/05/2032	114.568	0,12	EUR	100.000	Permanent TSB Group Holdings plc FRN 25/04/2028	107.197	0,11
EUR	100.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 11/02/2025	102.348	0,10	EUR	100.000	Permanent TSB Group Holdings plc FRN 30/06/2029	107.265	0,11
EUR	200.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 16/05/2027	193.153	0,20	GBP	185.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III 4.88% 15/07/2028	188.174	0,19
EUR	100.000	Gruenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	97.931	0,10	Total de Irlanda			737.347	0,75
EUR	111.000	Gruenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	108.703	0,11	ITALIA				
EUR	155.000	IHO Verwaltungs GmbH 8.75% 15/05/2028	169.544	0,17	EUR	100.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.63% 25/01/2028	93.332	0,10
EUR	200.000	Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	163.097	0,17	EUR	100.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.00% 04/12/2028	92.845	0,09
EUR	115.000	Novelis Sheet Ingot GmbH 3.38% 15/04/2029	105.415	0,11	EUR	100.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.00% 15/01/2030	88.587	0,09
EUR	126.000	PCF GmbH 4.75% 15/04/2026	104.578	0,11	EUR	170.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1.88% 09/01/2026	161.524	0,16
EUR	191.000	Peach Property Finance GmbH 4.38% 15/11/2025	163.944	0,17	EUR	100.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA FRN 05/09/2027	104.821	0,11
EUR	100.000	Schaeffler AG 3.38% 12/10/2028	95.861	0,10	EUR	149.000	FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA 5.63% 01/08/2027	146.032	0,14
EUR	129.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH 2.00% 15/07/2025	131.812	0,13	EUR	100.000	Intesa Sanpaolo SpA FRN 12/07/2029	104.946	0,11
EUR	100.000	Vier Gas Transport GmbH 4.63% 26/09/2032	107.066	0,11	EUR	100.000	Lottomatica SpA 7.13% 01/06/2028	108.387	0,11
EUR	100.000	Vonovia SE 5.00% 23/11/2030	104.559	0,11	EUR	100.000	Lottomatica SpA 9.75% 30/09/2027	114.341	0,12
EUR	100.000	ZF Finance GmbH 2.25% 03/05/2028	89.853	0,09	EUR	113.000	Mundys SpA 1.88% 13/07/2027	107.247	0,11
EUR	100.000	ZF Finance GmbH 3.75% 21/09/2028	95.228	0,10	EUR	193.000	Nexi SpA 1.63% 30/04/2026	186.833	0,19
Total de Alemania			3.070.492	3,16	EUR	220.000	Telecom Italia SpA 2.75% 15/04/2025	222.803	0,23
GIBRALTAR				IRLANDA					
EUR	130.000	888 Acquisitions Limited 7.56% 15/07/2027	127.533	0,13	EUR	150.000	Telecom Italia SpA 3.63% 25/05/2026	151.629	0,15
Total de Gibraltar			127.533	0,13	EUR	225.000	Telecom Italia SpA 6.88% 15/02/2028	239.683	0,24
GRECIA				JAPÓN					
EUR	119.000	Eurobank SA FRN 26/01/2029	131.418	0,13	EUR	100.000	Softbank Group Corp. 3.13% 19/09/2025	99.887	0,10
Total de Grecia			131.418	0,13	Total de Japón			99.887	0,10
IRLANDA				JERSEY - ISLAS DEL CANAL					
EUR	100.000	AIB Group plc FRN 19/11/2029	100.832	0,10	EUR	100.000	Avis Budget Finance plc 4.75% 30/01/2026	103.882	0,11
EUR	100.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	94.138	0,10					
EUR	140.000	Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	139.741	0,14					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
JERSEY - ISLAS DEL CANAL (continuación)				LUXEMBURGO (continuación)					
EUR	100.000	Heathrow Funding Limited 1.13% 08/10/2030	84.882	0,09	EUR	100.000	Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl 3.50% 01/03/2028	98.450	0,10
GBP	50.000	Heathrow Funding Limited 6.45% 10/12/2031	62.416	0,06	Total de Luxemburgo				
EUR	100.000	Kane Bidco Limited 5.00% 15/02/2027	100.463	0,10	2.315.020 2,36				
Total de Jersey - Islas del Canal				351.643	0,36	MÉXICO			
LUXEMBURGO				LUXEMBURGO (continuación)					
EUR	200.000	Agps Bondco PLC 3.25% 05/08/2025	94.292	0,10	EUR	100.000	Petroleos Mexicanos 2.75% 21/04/2027	81.790	0,08
EUR	130.000	Altice Financing SA 2.25% 15/01/2025	135.790	0,14	EUR	149.000	Petroleos Mexicanos 4.75% 26/02/2029	119.426	0,12
EUR	164.000	Altice France Holding SA 8.00% 15/05/2027	100.463	0,10	Total de México				
GBP	120.000	Aroundtown SA 3.00% 16/10/2029	100.284	0,10	201.216 0,20				
GBP	140.000	B&M European Value Retail SA 3.63% 15/07/2025	165.460	0,17	PAÍSES BAJOS				
EUR	141.000	Canpack SA 2.38% 01/11/2027	128.953	0,13	EUR	137.000	Ashland Services BV 2.00% 30/01/2028	123.275	0,13
EUR	121.000	Cirsa Finance International Sarl 4.75% 22/05/2025	127.107	0,13	EUR	100.000	Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV 3.75% 15/01/2025	104.518	0,11
EUR	100.000	Cirsa Finance International Sarl 7.88% 31/07/2028	106.603	0,11	EUR	200.000	Constellium NV 4.25% 15/02/2026	207.328	0,21
EUR	100.000	Eurofins Scientific SE - Perp FRN	97.705	0,10	EUR	200.000	Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	205.890	0,21
EUR	100.000	Eurofins Scientific SE - Perp FRN	105.224	0,11	EUR	100.000	Digital Intrepid Holding BV 1.38% 18/07/2032	77.827	0,08
GBP	100.000	Garfunkelux Holdingco 3 SA 7.75% 01/11/2025	93.066	0,09	EUR	146.000	Dufry One BV 2.00% 15/02/2027	136.924	0,14
EUR	100.000	Grand City Properties SA 0.13% 11/01/2028	81.073	0,08	GBP	68.000	E.ON International Finance BV 6.25% 03/06/2030	84.848	0,09
EUR	229.000	InPost SA 2.25% 15/07/2027	211.356	0,21	EUR	100.000	House of HR Group BV 9.00% 03/11/2029	103.643	0,11
EUR	140.000	Loarre Investments Sarl 6.50% 15/05/2029	138.814	0,14	EUR	100.000	Naturgy Finance BV - Perp FRN	93.693	0,10
EUR	100.000	Matterhorn Telecom SA 4.00% 15/11/2027	99.014	0,10	EUR	100.000	OI European Group BV 2.88% 15/02/2025	103.226	0,11
EUR	100.000	P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	84.238	0,09	EUR	167.000	PPF Telecom Group BV 3.25% 29/09/2027	165.739	0,17
EUR	100.000	Prologis International Funding II SA 3.63% 07/03/2030	98.440	0,10	EUR	100.000	Repsol International Finance BV - Perp FRN	93.590	0,10
EUR	100.000	Sani/Ikos Financial Holdings 1 Sarl 5.63% 15/12/2026	98.101	0,10	EUR	100.000	Stedin Holding NV - Perp FRN	91.880	0,09
EUR	100.000	SELP Finance Sarl 3.75% 10/08/2027	101.043	0,11	EUR	136.209	Summer BidCo BV 9.00% 15/11/2025	140.445	0,15
EUR	44.000	Telecom Italia Finance SA 7.75% 24/01/2033	49.544	0,05	EUR	100.000	Telefonica Europe BV - Perp FRN	90.470	0,09
					EUR	100.000	Telefonica Europe BV - Perp FRN	90.470	0,09
					EUR	200.000	Telefonica Europe BV - Perp FRN	207.749	0,21
					EUR	100.000	Telefonica Europe BV - Perp FRN	104.685	0,11
					EUR	100.000	Telefonica Europe BV - Perp FRN	108.916	0,11
					EUR	287.000	TenneT Holding BV - Perp FRN	287.695	0,29

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)						
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)						
PAÍSES BAJOS (continuación)				SINGAPUR						
EUR	100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.63% 15/10/2028	82.903	0,08	USD	75.000	Pfizer Investment Enterprises Pte Limited 4.75% 19/05/2033	71.057	0,07	
EUR	200.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 3.75% 09/05/2027	192.042	0,20	USD	50.000	Pfizer Investment Enterprises Pte Limited 5.30% 19/05/2053	46.639	0,05	
EUR	100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.38% 09/05/2030	90.681	0,09	USD	40.000	Pfizer Investment Enterprises Pte Limited 5.34% 19/05/2063	36.472	0,04	
EUR	100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 7.38% 15/09/2029	107.759	0,11	Total de Singapur			154.168	0,16	
EUR	100.000	Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	79.645	0,08	ESPAÑA					
EUR	100.000	United Group BV 3.13% 15/02/2026	96.851	0,10	EUR	200.000	Banco de SAbadell SA FRN 07/02/2029	207.870	0,21	
EUR	120.000	United Group BV 4.00% 15/11/2027	110.997	0,11	EUR	100.000	Cellnex Finance Company 2.00% 15/02/2033	82.223	0,08	
EUR	100.000	Volkswagen International Finance NV 3.25% 18/11/2030	96.840	0,10	EUR	100.000	Cellnex Finance Company SA 1.00% 15/09/2027	91.804	0,09	
EUR	100.000	Vz Vendor Financing II BV 2.88% 15/01/2029	81.984	0,08	EUR	100.000	Cellnex Finance Company SA 1.25% 15/01/2029	88.405	0,09	
EUR	100.000	ZF Europe Finance BV 2.00% 23/02/2026	97.172	0,10	EUR	100.000	Cellnex Finance Company SA 1.50% 08/06/2028	91.499	0,09	
EUR	100.000	ZF Europe Finance BV 3.00% 23/10/2029	88.801	0,09	EUR	200.000	Cellnex Finance Company SA 2.25% 12/04/2026	200.009	0,21	
EUR	100.000	ZF Europe Finance BV 6.13% 13/03/2029	106.047	0,11	EUR	100.000	Cellnex Telecom SA 1.88% 26/06/2029	90.020	0,09	
Total de Países Bajos				3,95	EUR	100.000	Grifols SA 1.63% 15/02/2025	102.297	0,10	
NORUEGA					EUR	100.000	Grifols SA 2.25% 15/11/2027	93.495	0,10	
EUR	100.000	DNB Bank ASA FRN 21/09/2027	102.946	0,10	EUR	100.000	Grifols SA 3.20% 01/05/2025	102.166	0,10	
Total de Noruega				0,10	EUR	144.000	Grifols SA 3.88% 15/10/2028	129.666	0,14	
PORTUGAL					EUR	100.000	Kaixo Bondco Telecom SA 5.13% 30/09/2029	93.406	0,10	
EUR	100.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 14/03/2082	89.928	0,09	EUR	272.000	Lorca Telecom Bondco SA 4.00% 18/09/2027	268.037	0,27	
EUR	100.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 23/04/2083	105.059	0,11	Total de España				1.640.897	1,67
Total de Portugal				0,20	SUECIA					
RUMANÍA					EUR	162.000	Heimstaden Bostad AB - Perp FRN	75.724	0,08	
EUR	100.000	RCS & RDS SA 2.50% 05/02/2025	101.835	0,10	EUR	50.000	Heimstaden Bostad AB - Perp FRN	23.372	0,02	
Total de Rumanía				0,10	EUR	100.000	Intrum AB 4.88% 15/08/2025	96.446	0,10	
					EUR	100.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	91.921	0,09	
					EUR	100.000	Verisure Holding AB 3.88% 15/07/2026	99.819	0,10	
					EUR	100.000	Verisure Holding AB 7.13% 01/02/2028	107.169	0,11	
					EUR	155.000	Verisure Midholding A 5.25% 15/02/2029	144.387	0,15	
					Total de Suecia				638.838	0,65

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
SUIZA				REINO UNIDO (continuación)					
EUR	100.000	Credit Suisse AG 0.25% 01/09/2028	87.022	0,09	EUR	100.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 6.88% 15/11/2026	106.636	0,11
		Total de Suiza	87.022	0,09	GBP	200.000	Jerrold Finco plc 5.25% 15/01/2027	217.623	0,23
REINO UNIDO				REINO UNIDO (continuación)					
GBP	100.000	Barclays plc 3.25% 12/02/2027	110.315	0,11	EUR	100.000	Lloyds Bank Corporate Markets 4.13% 30/05/2027	105.281	0,11
EUR	103.000	BCP V Modular Services Finance II plc 4.75% 30/11/2028	91.441	0,09	GBP	201.000	Marks & Spencer plc 3.75% 19/05/2026	230.239	0,23
GBP	235.000	Bellis Acquisition Company 3.25% 16/02/2026	250.028	0,26	EUR	100.000	National Grid Electricity Transmission plc 0.82% 07/07/2032	78.963	0,08
GBP	100.000	Bellis Acquisition Company plc 4.50% 16/02/2026	108.657	0,11	GBP	100.000	National Grid Electricity Transmission plc 1.13% 07/07/2028	99.556	0,10
GBP	167.000	Boparan Finance plc 7.63% 30/11/2025	139.578	0,14	EUR	100.000	Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	87.158	0,09
USD	94.000	Bp Capital Markets plc - Perp FRN	90.031	0,09	EUR	200.000	Pinnacle Bidco plc 5.50% 15/02/2025	214.408	0,22
EUR	142.000	BP Capital Markets plc - Perp FRN	140.759	0,15	EUR	175.000	Pinnacle Bidco plc 8.25% 11/10/2028	184.964	0,19
EUR	100.000	British American Tobacco plc - Perp FRN	90.935	0,09	GBP	100.000	Premier Foods Finance plc 3.50% 15/10/2026	111.621	0,11
GBP	20.000	Broadgate Financing plc 5.00% 05/10/2031	23.067	0,02	GBP	100.000	Rolls-Royce plc 3.38% 18/06/2026	111.867	0,11
EUR	100.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	83.255	0,09	GBP	121.000	Rolls-Royce plc 5.75% 15/10/2027	140.611	0,14
GBP	100.000	Co-Operative Bank Finance plc FRN 06/04/2027	111.782	0,11	GBP	10.000	Santander UK plc - Perp 10.06%	16.160	0,02
GBP	137.000	Deuce Finco plc 5.50% 15/06/2027	147.284	0,15	EUR	171.000	Sherwood Financing plc 4.50% 15/11/2026	158.944	0,16
EUR	155.000	DS Smith plc 0.88% 12/09/2026	148.229	0,15	EUR	100.000	Synthomer plc 3.88% 01/07/2025	101.327	0,10
EUR	100.000	DS Smith plc 4.50% 27/07/2030	103.726	0,11	GBP	100.000	Telereal Securitisation plc FRN 10/12/2033	109.398	0,11
EUR	109.000	EC Finance plc 3.00% 15/10/2026	107.669	0,11	EUR	200.000	Thames Water Utilities Finance plc 0.88% 31/01/2028	174.035	0,17
EUR	19.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	19.706	0,02	EUR	100.000	Victoria plc 3.63% 26/08/2026	83.911	0,09
GBP	100.000	HSBC Holdings plc FRN 16/11/2034	126.394	0,13	GBP	311.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.25% 15/05/2029	328.407	0,34
EUR	100.000	Ineos Finance plc 3.38% 31/03/2026	99.918	0,10	EUR	100.000	Virgin Money UK plc FRN 29/10/2028	102.088	0,10
EUR	100.000	Ineos Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	96.622	0,10	GBP	155.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	178.626	0,18
EUR	119.000	Ineos Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	114.980	0,12	EUR	181.000	Vodafone Group plc FRN 30/08/2084	193.422	0,20
GBP	187.000	Iron Mountain UK plc 3.88% 15/11/2025	216.186	0,22	GBP	164.000	Zenith Finco plc 6.50% 30/06/2027	159.782	0,16
EUR	100.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 4.50% 15/07/2028	93.024	0,09			Total de Reino Unido	5.952.944	6,06
EUR	136.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 5.88% 15/11/2024	144.331	0,15					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)			
ESTADOS UNIDOS				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
USD	22.000 AEP Texas Inc. 3.45% 15/05/2051	13.992	0,01	USD	12.000 Connecticut Light and Power Company 5.25% 15/01/2053	10.944	0,01
USD	126.000 Amazon.com Inc. 4.70% 01/12/2032	120.554	0,13	EUR	100.000 Coty Inc. 5.75% 15/09/2028	106.779	0,11
USD	23.000 Amgen Inc. 2.20% 21/02/2027	20.649	0,02	USD	21.000 CSX Corp. 3.80% 15/04/2050	15.219	0,02
USD	35.000 Amgen Inc. 3.15% 21/02/2040	24.698	0,03	USD	20.000 CSX Corp. 4.50% 15/11/2052	16.282	0,02
USD	12.000 Amgen Inc. 4.20% 22/02/2052	9.012	0,01	USD	50.000 Eaton Corp. 4.35% 18/05/2028	48.125	0,05
USD	10.000 Amgen Inc. 4.88% 01/03/2053	8.306	0,01	USD	30.000 Emera USA Finance LP 4.75% 15/06/2046	22.242	0,02
USD	59.000 Amgen Inc. 5.25% 02/03/2030	57.665	0,06	USD	169.000 Eversource Energy 2.55% 15/03/2031	135.029	0,14
USD	122.000 Amgen Inc. 5.25% 02/03/2033	116.778	0,11	USD	23.000 Eversource Energy 5.45% 01/03/2028	22.730	0,02
USD	19.000 Amgen Inc. 5.65% 02/03/2053	17.780	0,02	USD	20.000 Federal Home Loan Banks 5.50% 15/07/2036	21.183	0,02
USD	81.000 Amgen Inc. 5.75% 02/03/2063	74.874	0,07	GBP	100.000 Ford Motor Credit Company LLC 2.75% 14/06/2024	118.096	0,12
EUR	219.000 Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 2.00% 01/09/2028	192.994	0,19	GBP	200.000 Ford Motor Credit Company LLC 4.54% 06/03/2025	234.855	0,24
USD	114.000 Astrazeneca Finance LLC 4.88% 03/03/2028	112.009	0,11	EUR	139.000 Ford Motor Credit Company LLC 4.87% 03/08/2027	145.376	0,15
USD	89.000 AT&T Inc. 3.50% 15/09/2053	54.941	0,06	GBP	108.000 Ford Motor Credit Company LLC 6.86% 05/06/2026	129.956	0,13
USD	44.000 AT&T Inc. 4.90% 15/08/2037	38.160	0,04	USD	19.000 Georgia Power Company 3.70% 30/01/2050	13.327	0,01
EUR	158.000 Avantor Funding Inc. 2.63% 01/11/2025	160.227	0,16	USD	15.000 Georgia Power Company 5.13% 15/05/2052	13.259	0,01
USD	30.000 Bank of America Corp. FRN 21/07/2032	22.727	0,02	USD	26.000 Goodman USA Finance Three 3.70% 15/03/2028	23.351	0,02
USD	53.000 Bank of America Corp. FRN 13/02/2031	42.555	0,04	USD	20.000 HCA Inc. 5.88% 01/02/2029	19.691	0,02
USD	91.000 Bank of America Corp. FRN 29/04/2031	73.202	0,07	USD	14.000 Indiana Michigan Power Company 5.63% 01/04/2053	13.238	0,01
USD	66.000 Bank of America Corp. FRN 11/03/2032	52.010	0,05	USD	36.000 Intel Corp. 4.75% 25/03/2050	29.889	0,03
USD	60.000 Bank of America Corp. FRN 04/02/2033	47.330	0,05	EUR	200.000 IQVIA Inc. 2.25% 15/01/2028	185.890	0,19
USD	42.000 Bank of America Corp. FRN 23/07/2030	35.934	0,04	EUR	116.000 IQVIA Inc. 2.25% 15/03/2029	102.851	0,10
USD	91.000 Berkshire Hathaway Finance Corp. 3.85% 15/03/2052	68.126	0,07	EUR	100.000 IQVIA Inc. 2.88% 15/06/2028	94.497	0,10
USD	25.000 Boeing Company 3.95% 01/08/2059	16.449	0,02	USD	40.000 JPMorgan Chase & Company FRN 04/02/2032	30.334	0,03
USD	30.000 Boeing Company 5.93% 01/05/2060	26.967	0,03	USD	159.000 JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2032	125.532	0,13
USD	12.000 Broadcom Inc. 4.15% 15/11/2030	10.644	0,01	USD	33.000 JPMorgan Chase & Company FRN 25/01/2033	26.329	0,03
EUR	100.000 Catalent Pharma Solutions Inc. 2.38% 01/03/2028	89.003	0,09	USD	78.000 Kinder Morgan Energy Partners LP 5.00% 01/03/2043	63.025	0,07
USD	18.000 Charter Communications Operating LLC 3.90% 01/06/2052	10.771	0,01	USD	17.000 Kinder Morgan Inc. 5.20% 01/06/2033	15.720	0,02
USD	40.000 Charter Communications Operating LLC 3.95% 30/06/2062	22.740	0,02	USD	23.000 L3Harris Technologies Inc. 5.40% 31/07/2033	22.120	0,02
USD	13.000 Commonwealth Edison Company 5.30% 01/02/2053	11.954	0,01	USD	12.000 Lowe's Companies Inc. 5.75% 01/07/2053	11.208	0,01

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
ESTADOS UNIDOS (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)					
USD	51.000	Lowe's Companies Inc. 5.80% 15/09/2062	46.547	0,05	GBP	50.000	Time Warner Cable Inc. 5.75% 02/06/2031	57.027	0,06
USD	10.000	LYB International Finance III LLC 4.20% 01/05/2050	7.054	0,01	USD	23.000	T-Mobile USA Inc. 2.63% 15/02/2029	19.585	0,02
USD	23.000	LYB International Finance III LLC 5.63% 15/05/2033	22.184	0,02	USD	42.000	T-Mobile USA Inc. 2.88% 15/02/2031	34.161	0,03
USD	57.000	Merck & Company Inc. 4.50% 17/05/2033	53.376	0,05	USD	26.000	T-Mobile USA Inc. 4.95% 15/03/2028	25.253	0,03
EUR	100.000	Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	100.630	0,10	USD	17.000	T-Mobile USA Inc. 5.80% 15/09/2062	15.407	0,02
USD	25.000	NiSource Inc. 4.38% 15/05/2047	19.260	0,02	USD	82.000	UnitedHealth Group Inc. 4.50% 15/04/2033	75.939	0,08
USD	100.000	NiSource Inc. 4.80% 15/02/2044	82.257	0,08	USD	34.000	UnitedHealth Group Inc. 4.95% 15/05/2062	29.270	0,03
USD	14.000	NiSource Inc. 5.00% 15/06/2052	11.671	0,01	USD	60.000	UnitedHealth Group Inc. 5.30% 15/02/2030	59.693	0,06
USD	28.000	NiSource Inc. 5.40% 30/06/2033	26.767	0,03	USD	20.000	UnitedHealth Group Inc. 6.05% 15/02/2063	20.242	0,02
USD	28.000	Occidental Petroleum Corp. 6.38% 01/09/2028	28.244	0,03	USD	45.000	Verizon Communications Inc. 4.40% 01/11/2034	39.126	0,04
USD	56.000	Occidental Petroleum Corp. 6.63% 01/09/2030	56.704	0,06	USD	134.000	Warnermedia Holdings Inc. 5.14% 15/03/2052	99.725	0,10
USD	30.000	Occidental Petroleum Corp. 8.50% 15/07/2027	32.135	0,03	USD	50.000	Williams Partners LP 4.85% 01/03/2048	40.131	0,04
USD	65.000	Occidental Petroleum Corp. 8.88% 15/07/2030	72.948	0,07			Total de Estados Unidos	5.013.877	5,08
USD	29.000	Oracle Corp. 3.60% 01/04/2040	20.811	0,02			Total de bonos	31.424.315	32,02
USD	29.000	Oracle Corp. 3.65% 25/03/2041	20.709	0,02			Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda		
USD	97.000	Pacific Gas and Electric Company 4.95% 01/07/2050	72.351	0,07			AUSTRALIA		
USD	10.000	Pacificorp 4.13% 15/01/2049	7.051	0,01	AUD	18.000	Australia (Govt of) 1.00% 21/12/2030	9.237	0,01
USD	10.000	PacifiCorp 5.50% 15/05/2054	8.488	0,01	AUD	20.000	Australia (Govt of) 1.75% 21/06/2051	6.834	0,01
USD	20.000	Piedmont Natural Gas Company Inc. 3.35% 01/06/2050	12.404	0,01			Total de Australia	16.071	0,02
USD	39.000	Plains All American Pipeline LP 3.55% 15/12/2029	33.554	0,03			AUSTRIA		
USD	39.000	Plains All American Pipeline LP 4.70% 15/06/2044	28.861	0,03	EUR	113.000	Austria (Govt of) 0.50% 20/02/2029	103.769	0,11
USD	80.000	PNC Financial Services Group Inc. FRN 18/08/2034	76.931	0,08	EUR	10.000	Austria (Govt of) 1.50% 02/11/2086	5.309	0,01
USD	56.000	Public Service Electric and Gas Company 4.65% 15/03/2033	52.720	0,05	EUR	175.000	Austria (Govt of) 2.90% 20/02/2033	177.461	0,18
USD	28.000	RELX Capital Inc. 4.75% 20/05/2032	26.192	0,03			Total de Austria	286.539	0,30
USD	16.000	Republic Services Inc. 4.88% 01/04/2029	15.564	0,02					
USD	60.000	RTX Corp. 1.90% 01/09/2031	45.415	0,05					
USD	30.000	RTX Corp. 5.15% 27/02/2033	28.440	0,03					
EUR	100.000	Silgan Holdings Inc. 2.25% 01/06/2028	90.212	0,09					
USD	13.000	Southern California Gas Company 3.95% 15/02/2050	9.230	0,01					
USD	20.000	Thermo Fisher Scientific Inc. 4.98% 10/08/2030	19.480	0,02					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)				Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)					
BÉLGICA				JAPÓN					
EUR	65.000	Belgium (Govt of) 3.00% 22/06/2034	65.603	0,07	JPY	800.000	Japan (Govt of) 0.40% 20/06/2049	4.013	0,00
		Total de Bélgica	65.603	0,07	JPY	10.000.000	Japan (Govt of) 0.40% 20/03/2056	45.863	0,05
					JPY	4.150.000	Japan (Govt of) 0.50% 20/03/2059	19.076	0,02
CANADÁ					JPY	1.300.000	Japan (Govt of) 0.60% 20/09/2050	6.765	0,01
CAD	42.000	Canada (Govt of) 2.75% 01/12/2048	25.539	0,03	JPY	2.200.000	Japan (Govt of) 0.70% 20/12/2051	11.632	0,01
CAD	230.000	Canada Housing Trust No 1 1.10% 15/03/2031	133.883	0,14			Total de Japón	87.349	0,09
USD	80.000	Province of Ontario 1.13% 07/10/2030	62.165	0,06					
		Total de Canadá	221.587	0,23	MÉXICO				
					USD	968.000	Mexico (Govt of) 5.75% 12/10/2110	772.830	0,79
FRANCIA							Total de México	772.830	0,79
EUR	100.000	Bpifrance SACA 2.88% 25/11/2029	102.060	0,10	ESPAÑA				
EUR	100.000	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0.00% 25/02/2028	91.309	0,09	EUR	45.000	Instituto de Credito Oficial 0.00% 30/04/2027	41.871	0,04
USD	200.000	Caisse D'amortissement de la Dette Sociale 1.00% 21/10/2030	154.056	0,16	EUR	9.000	Spain (Govt of) 0.10% 30/04/2031	7.309	0,01
USD	200.000	Caisse D'amortissement de la Dette Sociale 1.38% 20/01/2031	157.554	0,16	EUR	18.000	Spain (Govt of) 2.90% 31/10/2046	15.008	0,02
EUR	84.000	France (Govt of) 1.25% 25/05/2034	71.692	0,07			Total de España	64.188	0,07
EUR	100.000	Unedic Asseo 0.25% 16/07/2035	71.948	0,07	SUPRANACIONAL				
		Total de Francia	648.619	0,65	USD	80.000	Asian Development Bank 0.75% 08/10/2030	61.071	0,06
ALEMANIA					GBP	49.000	Asian Infrastructure Investment Bank 4.38% 11/06/2026	58.471	0,06
EUR	37.000	Germany (Govt of) 0.00% 15/02/2032	31.231	0,03	USD	25.000	European Investment Bank 0.63% 21/10/2027	21.271	0,02
EUR	5.000	Germany (Govt of) 0.00% 15/08/2052	2.287	0,00	USD	25.000	European Investment Bank 1.63% 13/05/2031	20.202	0,02
EUR	64.000	Germany (Govt of) 1.70% 15/08/2032	62.139	0,06	USD	40.000	Inter-American Development Bank 1.13% 13/01/2031	31.278	0,03
		Total de Alemania	95.657	0,09	GBP	72.000	Inter-American Development Bank 2.13% 15/12/2028	77.400	0,08
ITALIA					EUR	18.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.20% 21/01/2061	5.792	0,01
USD	200.000	Italy (Govt of) 1.25% 17/02/2026	180.464	0,18	USD	135.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.75% 11/03/2025	126.342	0,14
EUR	44.000	Italy (Govt of) 2.45% 01/09/2033	38.554	0,04					
EUR	3.000	Italy (Govt of) 4.00% 30/04/2035	2.955	0,00					
		Total de Italia	221.973	0,22					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)				Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)					
SUPRANACIONAL (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)					
USD	80.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.88% 14/05/2030	62.485	0,06	USD	2.100.000	United States Treasury N/B 3.38% 15/08/2042	1.702.313	1,73
AUD	70.000	International Finance Corp. 1.50% 15/04/2035	30.202	0,03	USD	1.750.000	United States Treasury N/B 3.88% 15/02/2043	1.523.867	1,55
Total de supranacional			494.514	0,51	USD	164.000	United States Treasury N/B 4.00% 31/10/2029	158.414	0,16
					USD	10.000	United States Treasury N/B 4.00% 15/11/2052	8.866	0,01
REINO UNIDO				Total de Estados Unidos					
GBP	344.000	United Kingdom Gilt 0.63% 31/07/2035	270.297	0,28	7.035.163				
GBP	275.000	United Kingdom Gilt 0.88% 31/07/2033	241.296	0,25	7,16				
GBP	90.000	United Kingdom Gilt 1.00% 22/04/2024	107.431	0,11	Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				
GBP	3.000	United Kingdom Gilt 1.13% 31/01/2039	2.231	0,00	14.354.525				
GBP	1.628.000	United Kingdom Gilt 1.25% 31/07/2051	897.990	0,92	14,63				
GBP	4.000	United Kingdom Gilt 1.75% 07/09/2037	3.435	0,00	Renta variable				
GBP	2.000	United Kingdom Gilt 2.50% 22/07/2065	1.458	0,00	AUSTRALIA				
GBP	850.000	United Kingdom Gilt 3.25% 31/01/2033	945.517	0,96	9.444	ANZ Group Holdings Limited	156.402	0,16	
GBP	25.000	United Kingdom Gilt 3.75% 22/07/2052	25.286	0,03	5.886	Carsales.com Limited	106.139	0,11	
GBP	1.700.000	United Kingdom Inflation-Linked Gilt 0.16% 22/03/2051	1.849.491	1,88	48.798	Deterra Royalties Limited	150.857	0,15	
Total de Reino Unido			4.344.432	4,43	16.090	Dexus	75.807	0,08	
ESTADOS UNIDOS				Total de Australia					
USD	663.000	United States Treasury N/B 0.63% 15/08/2030	509.215	0,52	994	Macquarie Group Limited	107.603	0,11	
USD	86.000	United States Treasury N/B 1.00% 31/07/2028	72.569	0,07	2.195	Mineral Resources Limited	95.808	0,10	
USD	77.100	United States Treasury N/B 1.13% 15/08/2040	43.845	0,04	42.268	Santos Limited	215.510	0,22	
USD	90.000	United States Treasury N/B 1.25% 15/05/2050	42.490	0,04	51.955	Telstra Group Limited	129.097	0,13	
USD	41.000	United States Treasury N/B 2.00% 15/11/2041	26.628	0,03	20.542	Transurban Group	168.242	0,17	
USD	125.000	United States Treasury N/B 2.38% 31/03/2029	111.318	0,11	Total de Bélgica				
USD	3.763.200	United States Treasury N/B 3.00% 15/08/2052	2.743.607	2,81	184.359				
USD	99.000	United States Treasury N/B 3.25% 30/06/2029	92.031	0,09	0,18				
				CANADÁ					
				ISLAS CAIMÁN					
				990	KBC Ancora	40.564	0,04		
				1.306	KBC Group NV	81.775	0,08		
				717	Melexis NV	62.020	0,06		
				Total de Canadá					
				103.579					
				0,10					
				34.000	China Resources Land Limited	135.447	0,14		
				7.650	JD.com Inc.	112.428	0,11		
				249	NetEase Inc. - ADR	24.940	0,03		
				7.955	NetEase Inc.	162.008	0,17		

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Renta variable (continuación)				Renta variable (continuación)				
ISLAS CAIMÁN (continuación)				ALEMANIA (continuación)				
11.600	Shenzhou International Group Holdings Limited	111.085	0,11	1.042	SAP SE	135.497	0,14	
				1.071	Siemens AG - Reg	153.828	0,16	
	Total de Islas Caimán	545.908	0,56		Total de Alemania	709.470	0,72	
CHINA				GUERNSEY - ISLAS DEL CANAL				
104.000	Baoshan Iron & Steel Company Limited - A	86.931	0,09	27.224	Sherborne Investors Guernsey	19.023	0,02	
104.000	China Construction Bank Corp.	58.694	0,06		Total de Guernsey - Islas del Canal	19.023	0,02	
19.600	Inner Mongolia Yili Industrial Group Company Limited - A	71.371	0,07					
15.500	Ping An Insurance Group Company of China Limited	88.763	0,09					
3.200	Wuliangye Yibin Company Limited - A	68.561	0,07					
	Total de China	374.320	0,38					
DINAMARCA				HONG KONG				
630	Novo Nordisk A/S	57.596	0,06	26.800	AIA Group Limited	218.490	0,22	
6.942	Tryg A/S	127.492	0,13	34.500	Boc Hong Kong Holdings Limited	94.489	0,10	
	Total de Dinamarca	185.088	0,19	24.000	Galaxy Entertainment Group Limited	144.487	0,15	
				4.800	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	179.330	0,18	
				120.000	Lenovo Group Limited	123.649	0,13	
				24.800	Link Real Estate Investment Trust	121.596	0,12	
					Total de Hong Kong	882.041	0,90	
FINLANDIA				INDIA				
2.899	Upm-Kymmene Oyj	99.661	0,11	2.327	Bajaj Auto Limited	141.894	0,14	
	Total de Finlandia	99.661	0,11	38.687	Embassy Office Parks REIT	140.045	0,14	
				10.363	HDFC Bank Limited	190.469	0,19	
FRANCIA					8.969	Infosys Limited	155.035	0,16
623	Air Liquide SA	105.432	0,12	29.148	ITC Limited	155.985	0,16	
4.773	Antin Infrastructure Partners SA	61.803	0,06	68.870	Power Grid Corp. of India Limited	165.659	0,17	
6.428	AXA SA	191.783	0,20		Total de India	949.087	0,96	
1.647	BNP Paribas SA	105.375	0,11					
1.499	Compagnie de Saint-Gobain	90.272	0,09					
132	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	100.120	0,10					
721	Schneider Electric SE	119.832	0,12					
2.883	TotalEnergies SE	190.194	0,19					
811	Vinci SA	90.175	0,09					
	Total de Francia	1.054.986	1,08					
ALEMANIA				INDONESIA				
2.561	Daimler Truck Holding AG	88.990	0,09	184.200	Bank Negara Indonesia Tbk PT	123.051	0,13	
9.794	Deutsche Telekom AG - Reg	206.020	0,20	516.421	Bank Rakyat Indonesia	174.580	0,18	
3.099	E.ON SE	36.748	0,04	178.800	Indofood Cbp Sukses Makmur Tbk PT	128.119	0,14	
2.358	Evonik Industries AG	43.252	0,04		Total de Indonesia	425.750	0,45	
647	Mercedes-Benz Group AG - Reg	45.135	0,05					
ALEMANIA				IRLANDA				
				8.904	Bank of Ireland Group plc	87.578	0,09	
				2.754	CRH plc	152.675	0,16	
				2.901	Eaton Corp. plc	618.725	0,62	
				1.985	Experian plc	65.197	0,07	

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)				Renta variable (continuación)			
IRLANDA (continuación)				REPÚBLICA DE COREA (SUR)			
5.173	Johnson Controls International plc	275.255	0,28	1.967	Samsung Electronics Company Limited	99.706	0,10
118	Linde plc	43.938	0,05	9.275	Samsung Electronics Company Limited Pfd	374.602	0,38
7.521	Medtronic Inc.	589.346	0,60	3.702	SK Telecom Company Limited	142.659	0,15
1.249	Smurfit Kappa Group plc	41.618	0,04				
2.867	Trinseo plc	23.423	0,02				
	Total de Irlanda	1.897.755	1,93		Total de República de Corea (Sur)	616.967	0,63
ITALIA				SINGAPUR			
30.025	Enel SpA	185.012	0,19	52.600	CapitaLand Ascendas REIT	105.978	0,11
13.919	FincoBank Banca Fineco SpA	169.694	0,17	6.200	DBS Group Holdings Limited	152.808	0,16
12.823	Nexi SpA	78.580	0,08	23.000	Keppel Corp. Limited	114.587	0,12
	Total de Italia	433.286	0,44		Total de Singapur	373.373	0,39
JAPÓN				ESPAÑA			
800	Rohm Company Limited	15.102	0,02	8.743	Iberdrola SA	98.074	0,10
100	SMC Corp.	44.885	0,05	3.074	Inditex SA	114.855	0,12
300	Tokyo Electron Limited	41.092	0,04		Total de España	212.929	0,22
15.200	Z Holdings Corp.	42.323	0,04				
	Total de Japón	143.402	0,15	SUIZA			
JERSEY - ISLAS DEL CANAL				83 Burckhardt Compression Holding AG			
8.908	WPP plc	79.697	0,08	111	Lonza Group AG - Reg	51.641	0,05
	Total de Jersey - Islas del Canal	79.697	0,08	646	Nestle SA - Reg	73.258	0,07
PAÍSES BAJOS				77 Partners Group Holding AG - Reg			
533	Akzo Nobel NV	38.644	0,04	493	Roche Holding AG	134.971	0,14
221	ASM International NV	93.009	0,09	3.435	TE Connectivity Limited	424.326	0,43
793	BE Semiconductor Industries	78.082	0,08		Total de Suiza	816.591	0,82
31.291	Royal KPN NV	103.330	0,11	TAIWÁN			
	Total de Países Bajos	313.065	0,32	11.147	Chailease Holding Company Limited	62.501	0,06
NORUEGA				18.000	Chroma ATE Inc.	153.899	0,16
1.368	Equinor ASA	45.144	0,05	13.000	Delta Electronics Inc.	130.681	0,14
5.220	TGS ASA	71.916	0,07	17.000	E Ink Holdings Inc.	94.529	0,10
	Total de Noruega	117.060	0,12	1.000	eMemory Technology Inc.	62.421	0,06
FILIPINAS				2.000	MediaTek Inc.	45.538	0,05
60.780	BDO Unibank Inc.	152.441	0,16	37.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	599.455	0,61
	Total de Filipinas	152.441	0,16	23.000	Unimicron Technology Corp.	123.618	0,13
				7.000	Yageo Corp.	113.844	0,12
					Total de Taiwán	1.386.486	1,43

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)				Renta variable (continuación)			
TAILANDIA				REINO UNIDO (continuación)			
969.259	WHA Corp plc	139.748	0,14	12.556	RS Group plc	112.702	0,11
	Total de Tailandia	139.748	0,14	3.388	Smith & Nephew plc	42.303	0,04
REINO UNIDO				2.753	Smiths Group plc	54.418	0,06
7.241	3i Group plc	183.212	0,19	7.594	SSE plc	149.229	0,15
13.934	Allfunds Group plc	77.304	0,08	5.689	Tate & Lyle plc	47.599	0,05
4.193	Anglo American plc	115.943	0,12	17.795	Tesco plc	57.383	0,06
1.491	Ashtead Group plc	91.028	0,09	3.885	Travis Perkins plc	40.040	0,04
1.863	Astrazeneca plc	252.447	0,26	1.399	Unilever plc	69.361	0,07
1.514	BAE Systems plc	18.438	0,02	695	Victrex plc	11.918	0,01
2.398	Britvic plc	25.522	0,03	80.328	Vodafone Group plc	75.318	0,08
66.394	BT Group plc	94.570	0,10	905	Whitbread plc	38.263	0,04
44.996	Centrica plc	84.824	0,09	8.345	Wincanton plc	27.908	0,03
5.970	Chesnara plc	20.038	0,02		Total de Reino Unido	3.518.354	3,59
2.508	Compass Group	61.223	0,06	ESTADOS UNIDOS			
2.420	Diageo plc	89.616	0,09	450	AbbVie Inc.	67.077	0,07
19.823	Direct Line Insurance Group plc	41.664	0,04	5.136	Ameren Corp.	384.327	0,39
8.525	Dowlais Group plc	11.175	0,01	6.001	American Electric Power Company Inc.	451.395	0,46
12.172	DS Smith plc	42.653	0,04	322	American Express Company	48.039	0,05
9.544	Elementis plc	14.468	0,01	127	Analog Devices Inc.	22.236	0,02
403	Ferguson plc	66.724	0,07	2.573	Apple Inc.	440.524	0,44
22.344	Firstgroup plc	41.153	0,04	10.791	AT&T Inc.	162.081	0,16
7.893	GSK plc	143.736	0,15	2.235	Automatic Data Processing Inc.	537.697	0,55
7.574	Haleon plc	31.510	0,03	735	Baxter International Inc.	27.739	0,03
33.942	Hays plc	45.239	0,05	1.110	Becton Dickinson & Company	286.968	0,29
1.810	Hikma Pharmaceuticals plc	46.128	0,05	524	BlackRock Inc.	338.761	0,35
2.850	IMI plc	54.544	0,06	5.382	Boston Properties Inc.	320.121	0,33
7.299	Imperial Brands plc	148.510	0,15	8.628	Bristol-Myers Squibb Company	500.769	0,51
7.253	International Distributions Services plc	23.088	0,02	1.633	Broadcom Inc.	1.356.336	1,38
48.294	ITV plc	41.627	0,04	1.248	Caterpillar Inc.	340.704	0,35
1.838	Johnson Matthey plc	36.522	0,04	11.730	Cisco Systems Inc.	630.605	0,64
7.702	Land Securities Group plc	55.445	0,06	2.034	CME Group Inc.	407.248	0,41
24.699	Legal & General Group plc	67.076	0,07	789	Coca Cola Company	44.168	0,05
567	London Stock Exchange Group plc	56.984	0,06	11.978	Comcast Corp.	531.105	0,55
26.801	Marks & Spencer Group plc	77.397	0,08	3.219	Conocophillips	385.636	0,39
8.058	Morgan Advanced Materials plc	24.096	0,02	4.183	DuPont de Nemours Inc.	312.010	0,32
1.514	Morgan Sindall plc	37.975	0,04	7.678	Ebay Inc.	338.523	0,35
2.228	Oxford Instruments plc	59.283	0,06	3.853	Edison International	243.856	0,25
10.371	Pearson plc	109.925	0,11	135	Elevance Health Inc.	58.782	0,06
10.432	Phoenix Group Holdings plc	61.397	0,06	2.074	Eli Lilly & Company	1.114.008	1,13
1.467	Reckitt Benckiser Group plc	103.744	0,11	4.802	Equity Lifestyle Properties Inc.	305.935	0,31
1.012	RELX plc	34.340	0,03	8.364	Exxon Mobil Corp.	983.439	1,01
2.372	RELX plc	80.340	0,08	19.271	Gen Digital Inc.	340.711	0,35
16.247	Rentokil Initial plc	121.004	0,12	1.615	General Motors Company	53.247	0,05
				831	Goldman Sachs Group Inc.	268.887	0,27
				2.171	Hess Corp.	332.163	0,34

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente					
Renta variable (continuación)				Bonos					
ESTADOS UNIDOS (continuación)				AUSTRALIA					
2.376	Honeywell International Inc.	438.941	0,44	USD	35.000	APT Pipelines Limited 4.25% 15/07/2027	33.041	0,03	
767	IntercontinentalExchange Inc.	84.385	0,09						
294	ITT Inc.	28.786	0,03	USD	97.000	Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	89.672	0,09	
2.290	JPMorgan Chase & Company	332.095	0,33	Total de Australia				122.713	0,12
1.850	KLA Corp.	848.521	0,86	BERMUDAS					
7.050	Kontoor Brands Inc.	309.566	0,32	USD	250.000	Bacardi Limited 4.70% 15/05/2028	238.017	0,24	
2.135	Lamb Weston Holding Inc.	197.402	0,20	Total de Bermudas				238.017	0,24
1.436	Lowe's Companies Inc.	298.458	0,30	DINAMARCA					
284	Marsh & McLennan Companies Inc.	54.045	0,06	USD	200.000	Danske Bank A/S 1.55% 10/09/2027	175.155	0,18	
820	Mastercard Inc. - A	324.646	0,33	Total de Dinamarca				175.155	0,18
151	McDonald's Corp.	39.779	0,04	PAÍSES BAJOS					
7.053	Merck & Company Inc.	726.106	0,73	USD	15.000	E.ON International Finance BV 6.65% 30/04/2038	15.134	0,02	
8.251	Metlife Inc.	519.071	0,53	GBP	100.000	GTCR W-2 Merger Sub LLC 8.50% 15/01/2031	124.702	0,13	
6.626	Microsoft Corp.	2.092.160	2,12	Total de Países Bajos				139.836	0,15
4.872	Moelis & Company - A	219.873	0,22	SUPRANACIONAL					
6.260	Morgan Stanley	511.253	0,51	USD	100.000	Bacardi Limited 5.40% 15/06/2033	93.674	0,10	
3.218	Northern Trust Corp.	223.587	0,23	Total de supranacional				93.674	0,10
2.746	PepsiCo Inc.	465.283	0,47	REINO UNIDO					
7.718	Philip Morris International Inc.	714.532	0,73	GBP	100.000	Market Bidco Finco plc 5.50% 04/11/2027	103.907	0,11	
282	PNC Financial Services	34.621	0,04	Total de Reino Unido				103.907	0,11
5.889	Procter & Gamble Company	858.969	0,88	ESTADOS UNIDOS					
5.240	Prologis Inc.	587.981	0,60	USD	21.000	American Transmission Systems Inc. 2.65% 15/01/2032	16.640	0,02	
222	Qualcomm Inc.	24.655	0,03	USD	23.000	Atlantic City Electric 2.30% 15/03/2031	18.294	0,02	
414	Quest Diagnostics Inc.	50.450	0,05	USD	80.000	BMW US Capital LLC 5.05% 11/08/2028	78.258	0,08	
4.455	Republic Services Inc.	634.882	0,65	USD	67.000	Broadcom Inc. 4.93% 15/05/2037	57.732	0,06	
4.972	Starbucks Corp.	453.794	0,46	USD	119.000	Carrier Global Corp. 2.72% 15/02/2030	99.354	0,10	
480	State Street Corp.	32.141	0,03	Total de Estados Unidos				27.082.275	27,57
1.855	Target Corp.	205.107	0,21	Total de renta variable				44.022.166	44,87
3.189	Texas Instruments Inc.	507.083	0,52	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				89.801.006	91,52
6.648	TJX Companies Inc.	590.875	0,60						
3.041	Union Pacific Corp.	619.239	0,64						
3.915	United Parcel Service Inc.	610.231	0,62						
2.932	Valero Energy Corp.	415.494	0,42						
4.737	Verizon Communications Inc.	153.526	0,16						
17.338	Vici Properties Inc.	504.536	0,51						
2.838	Virtu Financial Inc.	49.012	0,05						
3.856	Voya Financial Inc.	256.231	0,26						
2.532	Warner Bros Discovery Inc.	27.498	0,03						
6.217	Xcel Energy Inc.	355.737	0,36						
268	Zoetis Inc.	46.627	0,05						

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)					
Bonos (continuación)				Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda					
ESTADOS UNIDOS (continuación)				CHINA					
USD	25.000	ERAC USA Finance LLC 5.40% 01/05/2053	23.092	0,02	CNY	470.000	China (Govt of) 2.85% 04/06/2027	65.555	0,07
USD	100.000	GE HealthCare Technologies Inc. 5.86% 15/03/2030	99.228	0,10	CNY	2.530.000	China (Govt of) 3.02% 27/05/2031	355.288	0,36
USD	25.000	Guardian Life Insurance Company of America 4.85% 24/01/2077	18.821	0,02	Total de China			420.843	0,43
USD	34.000	HCA Inc. 3.63% 15/03/2032	28.154	0,03	ESTADOS UNIDOS				
USD	47.000	Jersey Central Power & Light Company 2.75% 01/03/2032	36.871	0,04	USD	28.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp. 6.65% 28/08/2036	28.043	0,03
USD	80.000	Mars Inc. 4.65% 20/04/2031	76.025	0,08	USD	139.000	Federal National Mortgage Association 5.63% 15/07/2037	148.593	0,15
USD	35.000	Metropolitan Edison Company 4.30% 15/01/2029	32.548	0,03	Total de Estados Unidos			176.636	0,18
USD	156.000	Metropolitan Life Global Funding I 1.55% 07/01/2031	117.469	0,12	Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				
USD	37.000	New York Life Global Funding 4.55% 28/01/2033	33.977	0,03	597.479 0,61				
USD	33.000	New York Life Global Funding 4.85% 09/01/2028	32.255	0,03	Bonos - convertibles				
USD	17.000	New York Life Insurance Company 4.45% 04/04/2069	12.499	0,01	CANADÁ				
USD	86.000	Northwestern Mutual Life Insurance Company 3.45% 30/03/2051	55.390	0,06	USD	117.000	Air Canada 4.00% 01/07/2025	132.235	0,13
USD	8.000	Northwestern Mutual Life Insurance Company 3.63% 30/09/2059	5.096	0,01	Total de Canadá			132.235	0,13
USD	25.000	Occidental Petroleum Corp. 7.88% 15/09/2031	27.128	0,03	Total de bonos - convertibles				
USD	50.000	Piedmont Natural Gas Co Inc. 5.40% 15/06/2033	47.767	0,05	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				
USD	200.000	Roche Holdings Inc. 1.93% 13/12/2028	170.846	0,17	2.816.673 2,88				
USD	75.000	Teachers Insurance & Annuity Association of America 4.27% 15/05/2047	57.235	0,06	Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario				
USD	11.000	Teachers Insurance & Annuity Association of America 4.90% 15/09/2044	9.269	0,01	Bonos				
USD	30.000	Verizon Communications Inc. 2.36% 15/03/2032	22.871	0,02	CANADÁ				
USD	50.000	Warnermedia Holdings Inc. 5.39% 15/03/2062	36.838	0,04	CAD	50.000	Rogers Communications Inc. 3.65% 31/03/2027	34.383	0,04
Total de Estados Unidos			1.213.657	1,24	Total de Canadá			34.383	0,04
Total de bonos			2.086.959	2,14	PORTUGAL				
					EUR	100.000	Banco Espirito Santo SA 0.00% 21/01/2099**	17.999	0,02
					Total de Portugal			17.999	0,02

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario (continuación)				
Bonos (continuación)				
REINO UNIDO				
GBP	205.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	235.389	0,23
Total de Reino Unido		235.389	0,23	
ESTADOS UNIDOS				
EUR	100.000	Emerald Debt Merger Sub LLC 6.38% 15/12/2030	105.654	0,10
EUR	100.000	Olympus Water US Holding Corp. 9.63% 15/11/2028	105.938	0,11
Total de Estados Unidos		211.592	0,21	
Total de bonos		499.363	0,50	
Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario		499.363	0,50	
Valor total de las inversiones		93.117.042	94,90	
(Coste total: 95.597.594 USD)				

* Diferencias menores debido al redondeo.

** Título a su valor razonable.

Threadneedle (Lux) - Global Focus

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2023

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
CANADÁ				REINO UNIDO			
353.958	Waste Connections Inc.	47.536.559	2,29	419.201	Ashtead Group plc	25.593.022	1,23
	Total de Canadá	47.536.559	2,29	1.140.618	Compass Group	27.843.626	1,34
				568.284	Diageo plc	21.044.402	1,01
				Total de Reino Unido			
						74.481.050	3,58
FRANCIA				ESTADOS UNIDOS			
387.023	Legrand SA	35.772.100	1,72	571.726	Alphabet Inc. - A	74.816.064	3,60
70.571	L'Oreal SA	29.378.743	1,41	567.925	Amazon.com Inc.	72.194.626	3,47
55.961	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	42.445.775	2,04	223.987	Apple Inc.	38.348.814	1,84
399.329	Schneider Electric SE	66.369.509	3,19	707.706	Coca Cola Company	39.617.382	1,90
	Total de Francia	173.966.127	8,36	97.426	Elevance Health Inc.	42.421.229	2,04
				81.589	Eli Lilly & Company	43.823.900	2,11
				221.484	Hess Corp.	33.887.052	1,63
				166.135	Hilton Worldwide Holdings Inc.	24.950.154	1,20
				464.231	Howmet Aerospace Inc.	21.470.684	1,03
				369.275	IntercontinentalExchange Inc.	40.627.636	1,95
				86.741	Intuit Inc.	44.319.446	2,13
				73.755	Intuitive Surgical Inc.	21.557.849	1,04
				96.208	Lam Research Corp.	60.300.288	2,91
				216.683	Marsh & McLennan Companies Inc.	41.234.775	1,99
				290.276	Mastercard Inc. - A	114.923.172	5,52
				77.997	McDonald's Corp.	20.547.530	0,99
				16.655	Mettler-Toledo International Inc.	18.454.906	0,89
				569.562	Microsoft Corp.	179.839.201	8,65
				120.675	Nvidia Corp.	52.492.418	2,52
				469.414	ON Semiconductor Corp.	43.632.031	2,10
				124.985	PepsiCo Inc.	21.177.458	1,02
				111.844	S&P Global Inc.	40.868.916	1,96
				166.529	Synopsys Inc.	76.431.816	3,67
				92.848	Thermo Fisher Scientific Inc.	46.996.872	2,26
				102.978	Union Pacific Corp.	20.969.410	1,01
				181.465	Visa Inc. - A	41.738.765	2,01
				224.990	Zoetis Inc.	39.143.760	1,88
				Total de Estados Unidos			
						1.316.786.154	63,32
				Total de renta variable			
						2.047.589.221	98,45
				Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa			
						2.047.589.221	98,45
HONG KONG							
2.767.000	AIA Group Limited	22.558.309	1,08				
	Total de Hong Kong	22.558.309	1,08				
INDIA							
5.407.450	HDFC Bank Limited	99.387.333	4,78				
	Total de India	99.387.333	4,78				
INDONESIA							
35.435.000	Bank Central Asia Tbk PT	20.232.588	0,97				
	Total de Indonesia	20.232.588	0,97				
IRLANDA							
608.240	CRH plc	33.719.233	1,62				
292.081	Linde plc	108.756.360	5,23				
	Total de Irlanda	142.475.593	6,85				
JAPÓN							
148.212	Keyence Corp.	55.123.243	2,65				
362.400	Sony Group Corp.	29.725.421	1,43				
	Total de Japón	84.848.664	4,08				
SUIZA							
859.960	UBS Group AG	21.329.788	1,03				
	Total de Suiza	21.329.788	1,03				
TAIWÁN							
2.715.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	43.987.056	2,11				
	Total de Taiwán	43.987.056	2,11				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Focus

Estado de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
15.014.624	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	15.014.624	0,72
	Total de Irlanda	15.014.624	0,72
	Total de fondos	15.014.624	0,72
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	15.014.624	0,72
	Valor total de las inversiones	2.062.603.845	99,17
	(Coste total: 1.910.792.758 USD)		

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2023

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
BRASIL				CHINA (continuación)			
1.125.319	B3 SA Brasil Bolsa Balcao	2.763.157	0,82	668.700	Inner Mongolia Yili Industrial Group Company Limited - A	2.434.970	0,73
452.799	Banco BTG Pactual SA	2.810.767	0,84	225.600	Midea Group Company Limited - A	1.717.911	0,51
145.088	Banco do Brasil SA	1.367.627	0,41	52.700	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Company Limited	1.951.613	0,58
783.812	Itau Unibanco Holding SA - ADR	4.209.070	1,25	1.796.200	Songcheng Performance Development Company Limited	3.012.665	0,90
389.667	Localiza Rent a Car SA	4.559.034	1,35	125.500	Sungrow Power Supply Company Limited	1.541.844	0,46
249.884	Petroleo Brasileiro SA - ADR	3.745.761	1,12	1.379.600	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls	5.623.862	1,67
469.797	PRIQ SA	4.415.254	1,31				
905.995	Sendas Distribuidora SA	2.201.088	0,66				
321.575	TOTVS SA	1.734.699	0,52				
324.588	Weg SA	2.352.113	0,70				
	Total de Brasil	30.158.570	8,98		Total de China	28.360.651	8,44
CANADÁ				GRECIA			
169.276	Parex Resources Inc.	3.191.454	0,95	1.570.968	Eurobank Ergasias SA	2.426.700	0,72
	Total de Canadá	3.191.454	0,95	746.059	National Bank of Greece SA	4.218.012	1,26
ISLAS CAIMÁN				HONG KONG			
543.000	Baidu Inc. - A	9.248.943	2,75	326.400	AIA Group Limited	2.661.016	0,79
726.000	China Resources Land Limited	2.892.196	0,86	239.500	Techtronic Industries Company Limited	2.324.104	0,69
295.651	Full Truck Alliance Company Limited	2.081.383	0,62				
495.000	Kingdee International Software Group Company Limited	609.283	0,18		Total de Hong Kong	4.985.120	1,48
415.500	Li Ning Company Limited	1.748.087	0,52	INDIA			
358.520	Meituan	5.246.075	1,56	65.959	APL Apollo Tubes Limited	1.290.702	0,38
377.070	NetEase Inc.	7.679.256	2,28	316.658	AU Small Finance Bank Limited	2.720.715	0,81
20.000	Parade Technologies Limited	609.647	0,18	304.683	Cholamandalam Investment and Finance Company Limited	4.467.182	1,33
71.580	PDD Holdings Inc.	7.019.850	2,09	142.633	HDFC Bank Limited - ADR	8.416.773	2,51
1.207.600	Sands China Limited	3.700.589	1,10	530.907	ICICI Bank Limited - ADR	12.274.569	3,66
166.300	Shenzhou International Group Holdings Limited	1.592.539	0,47	492.831	IndusInd Bank Limited	8.479.755	2,53
427.100	Tencent Holdings Limited	16.698.260	4,98	185.522	Jio Financial Services Limited	516.514	0,15
395.500	Wuxi Biologics Cayman Inc.	2.305.280	0,69	234.736	Larsen & Toubro Limited	8.546.641	2,54
	Total de Islas Caimán	61.431.388	18,28	139.116	Mahindra & Mahindra Limited	2.603.734	0,78
CHINA				422.117	Max Healthcare Institute Limited	2.884.170	0,86
458.000	Alibaba Group Holding Limited	5.005.826	1,49	38.999	Polycab India Limited	2.509.235	0,75
322.000	Beijing Oriental Yuhong Waterproof Technology Company Limited - A	1.179.144	0,35	80.868	Reliance Industries Limited	2.283.590	0,68
114.200	China Tourism Group Duty Free Corp. Limited	1.661.017	0,49	93.620	Varun Beverages Limited	1.066.156	0,32
168.600	Eastroc Beverage Group Company Limited	4.231.799	1,26		Total de India	58.059.736	17,30
				INDONESIA			
				7.966.700	Astra International Tbk PT	3.208.648	0,96
				13.480.200	Bank Central Asia Tbk PT	7.696.891	2,29

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities

Estado de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)				Renta variable (continuación)			
INDONESIA (continuación)				REPÚBLICA DE COREA (SUR) (continuación)			
26.999.366	Bank Rakyat Indonesia	9.127.338	2,72	70.496	SK hynix Inc.	5.992.211	1,78
	Total de Indonesia	20.032.877	5,97		Total de República de Corea (Sur)	35.035.100	10,43
JERSEY - ISLAS DEL CANAL				SUDÁFRICA			
39.790	WNS Holdings Limited - ADR	2.724.023	0,81	293.714	Absa Group Limited	2.725.659	0,81
	Total de Jersey - Islas del Canal	2.724.023	0,81	31.602	Capitec Bank Holdings Limited	2.879.031	0,86
				183.102	Shoprite Holdings Limited	2.331.018	0,69
					Total de Sudáfrica	7.935.708	2,36
KAZAJISTÁN				TAIWÁN			
20.730	Kaspi.KZ JSC	2.006.664	0,60	53.000	Aspeed Technology Inc.	4.539.671	1,35
	Total de Kazajistán	2.006.664	0,60	387.000	Delta Electronics Inc.	3.890.263	1,16
				27.000	eMemory Technology Inc.	1.685.358	0,50
LUXEMBURGO				TURQUÍA			
13.715	Globant SA	2.713.513	0,81	106.951	BIM Birlesik Magazalar AS	1.071.644	0,32
168.900	Samsonite International SA	580.121	0,17	326.824	KOC Holding AS	1.748.845	0,52
	Total de Luxemburgo	3.293.634	0,98		Total de Turquía	2.820.489	0,84
MÉXICO				ESTADOS UNIDOS			
280.814	Arca Continental SAB de CV	2.557.583	0,76	177.276	Coupage Inc.	3.013.692	0,90
280.133	Banco del Bajío SA	883.505	0,26	4.128	Mercadolibre Inc.	5.233.809	1,56
191.043	Grupo Aeroportuario del Pacífico SAB de CV - B	3.148.834	0,94		Total de Estados Unidos	8.247.501	2,46
755.012	Grupo Financiero Banorte SAB de CV	6.347.734	1,89				
1.092.871	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	4.125.321	1,23				
	Total de México	17.062.977	5,08				
FILIPINAS				ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)			
2.114.420	BDO Unibank Inc.	5.303.140	1,58	223.974	Fix Price Group Limited**	358.358	0,11
	Total de Filipinas	5.303.140	1,58		Total de Islas Vírgenes (Británicas)	358.358	0,11
POLONIA				Total de renta variable			
36.075	Dino Polska SA	2.933.895	0,87			333.896.898	99,43
	Total de Polonia	2.933.895	0,87				
REPÚBLICA DE COREA (SUR)				Derechos			
2.848	Samsung Biologics Company Limited	1.437.296	0,43	BRASIL			
40.824	Samsung Electro-Mechanics Company Limited	4.156.823	1,24	2.856	Localiza Rent a Car SA Right	9.130	0,00
401.698	Samsung Electronics Company Limited	20.361.745	6,06		Total de Brasil	9.130	0,00
8.136	Samsung Sdi Company Limited	3.087.025	0,92		Total de derechos	9.130	0,00
					Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	333.906.028	99,43

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities

Estado de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario			
Renta variable			
FEDERACIÓN RUSA			
597.602	Detsky Mir PJSC**	0	0,00
	Total de Federación Rusa	0	0,00
	Total de renta variable	0	0,00
	Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario	0	0,00
	Valor total de las inversiones	333.906.028	99,43
(Coste total: 335.470.782 USD)			

* Diferencias menores debido al redondeo.

** Título a su valor razonable.

Threadneedle (Lux) - Global Equity Income

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2023

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
AUSTRALIA				IRLANDA			
729.132	Telstra Group Limited	1.811.740	1,16	32.628	CRH plc	1.808.811	1,16
	Total de Australia	1.811.740	1,16	98.757	Experian plc	3.243.674	2,07
CANADÁ				24.847	Johnson Controls International plc	1.322.109	0,84
19.292	Canadian National Railway Company	2.098.861	1,34	5.901	Linde plc	2.197.237	1,40
86.089	Suncor Energy Inc.	2.974.273	1,90	38.212	Medtronic Inc.	2.994.292	1,91
	Total de Canadá	5.073.134	3,24		Total de Irlanda	11.566.123	7,38
ISLAS CAIMÁN				JAPÓN			
11.903	NetEase Inc. - ADR	1.192.204	0,76	41.200	Rohm Company Limited	777.754	0,50
	Total de Islas Caimán	1.192.204	0,76	5.900	SMC Corp.	2.648.229	1,69
DINAMARCA				6.200	Tokyo Electron Limited	849.241	0,54
53.319	Tryg A/S	979.216	0,63	739.600	Z Holdings Corp.	2.059.332	1,31
	Total de Dinamarca	979.216	0,63		Total de Japón	6.334.556	4,04
FRANCIA				JERSEY - ISLAS DEL CANAL			
84.035	AXA SA	2.507.233	1,60	84.566	WPP plc	756.581	0,48
46.501	BNP Paribas SA	2.975.146	1,90		Total de Jersey - Islas del Canal	756.581	0,48
19.604	Compagnie de Saint-Gobain	1.180.586	0,75	PAÍSES BAJOS			
9.198	Schneider Electric SE	1.528.731	0,98	26.098	Akzo Nobel NV	1.892.189	1,21
57.075	TotalEnergies SE	3.765.279	2,41		Total de Países Bajos	1.892.189	1,21
	Total de Francia	11.956.975	7,64	NORUEGA			
ALEMANIA				55.593	Equinor ASA	1.834.570	1,17
153.822	Deutsche Telekom AG - Reg	3.235.683	2,06		Total de Noruega	1.834.570	1,17
160.099	E.ON SE	1.898.454	1,21	REPÚBLICA DE COREA (SUR)			
117.184	Evonik Industries AG	2.149.488	1,37	95.822	Samsung Electronics Company Limited	4.857.140	3,09
18.200	SAP SE	2.366.649	1,51		Total de República de Corea (Sur)	4.857.140	3,09
23.062	Siemens AG - Reg	3.312.396	2,12	ESPAÑA			
	Total de Alemania	12.962.670	8,27	39.124	Inditex SA	1.461.801	0,93
HONG KONG					Total de España	1.461.801	0,93
242.200	AIA Group Limited	1.974.565	1,26	SUIZA			
39.100	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	1.460.789	0,93	15.508	TE Connectivity Limited	1.915.703	1,22
	Total de Hong Kong	3.435.354	2,19		Total de Suiza	1.915.703	1,22

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Equity Income

Estado de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)				Renta variable (continuación)			
TAIWÁN				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
92.000	MediaTek Inc.	2.094.732	1,34	9.532	United Parcel Service Inc.	1.485.753	0,95
172.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	2.786.657	1,78	41.447	Xcel Energy Inc.	2.371.597	1,51
				12.983	Zoetis Inc.	2.258.782	1,44
	Total de Taiwán	4.881.389	3,12		Total de Estados Unidos	64.529.184	41,22
					Total de renta variable	151.033.593	96,44
REINO UNIDO				Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa			
109.081	Anglo American plc	3.016.260	1,93			151.033.593	96,44
1.590.543	BT Group plc	2.265.541	1,45	Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
38.166	Diageo plc	1.413.344	0,90	Fondos			
122.591	GSK plc	2.232.456	1,43	IRLANDA			
42.496	Reckitt Benckiser Group plc	3.005.260	1,92	2.587.127	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	2.587.127	1,65
48.926	RELX plc	1.660.203	1,06		Total de Irlanda	2.587.127	1,65
	Total de Reino Unido	13.593.064	8,69		Total de fondos	2.587.127	1,65
ESTADOS UNIDOS					Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	2.587.127	1,65
21.917	AbbVie Inc.	3.266.948	2,09		Valor total de las inversiones	153.620.720	98,09
28.857	American Electric Power Company Inc.	2.170.624	1,39		(Coste total: 156.122.397 USD)		
15.741	American Express Company	2.348.400	1,50	<i>* Diferencias menores debido al redondeo.</i>			
6.481	Analog Devices Inc.	1.134.758	0,72				
35.640	Baxter International Inc.	1.345.054	0,86				
48.294	Bristol-Myers Squibb Company	2.802.984	1,79				
1.954	Broadcom Inc.	1.622.953	1,04				
38.922	Coca Cola Company	2.178.853	1,40				
21.717	Conocophillips	2.601.697	1,66				
55.884	Ebay Inc.	2.463.925	1,58				
6.680	Elevance Health Inc.	2.908.606	1,86				
4.176	Eli Lilly & Company	2.243.055	1,43				
79.906	General Motors Company	2.634.501	1,68				
37.891	IntercontinentalExchange Inc.	4.168.768	2,66				
14.344	ITT Inc.	1.404.421	0,90				
14.139	Marsh & McLennan Companies Inc.	2.690.652	1,72				
7.593	McDonald's Corp.	2.000.300	1,28				
13.879	Microsoft Corp.	4.382.295	2,80				
12.306	PepsiCo Inc.	2.085.129	1,33				
11.842	PNC Financial Services	1.453.842	0,93				
19.762	Procter & Gamble Company	2.882.485	1,84				
10.098	Prologis Inc.	1.133.097	0,72				
11.055	Qualcomm Inc.	1.227.768	0,78				
20.849	Quest Diagnostics Inc.	2.540.659	1,62				
24.504	State Street Corp.	1.640.788	1,05				
9.772	Target Corp.	1.080.490	0,69				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Select

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2023

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
AUSTRALIA				JAPÓN			
23.884	CSL Limited	3.866.015	0,76	12.200	Keyence Corp.	4.537.443	0,89
	Total de Australia	3.866.015	0,76	111.000	Recruit Holdings Company Limited	3.428.373	0,68
				56.400	Sony Group Corp.	4.626.142	0,91
					Total de Japón	12.591.958	2,48
CANADÁ				PAÍSES BAJOS			
89.936	Nutrien Limited	5.579.757	1,10	47.215	Akzo Nobel NV	3.423.239	0,67
37.547	Waste Connections Inc.	5.042.562	0,99		Total de Países Bajos	3.423.239	0,67
	Total de Canadá	10.622.319	2,09				
DINAMARCA				NORUEGA			
55.148	Novo Nordisk A/S	5.041.717	0,99	206.551	Equinor ASA	6.816.188	1,34
	Total de Dinamarca	5.041.717	0,99		Total de Noruega	6.816.188	1,34
FRANCIA				SINGAPUR			
192.837	AXA SA	5.753.402	1,14	343.300	DBS Group Holdings Limited	8.461.137	1,67
37.143	EssilorLuxottica SA	6.494.942	1,28		Total de Singapur	8.461.137	1,67
12.702	L'Oreal SA	5.287.849	1,04				
8.000	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	6.067.908	1,20				
43.579	Schneider Electric SE	7.242.942	1,43				
180.437	TotalEnergies SE	11.903.557	2,36				
	Total de Francia	42.750.600	8,45				
ALEMANIA				SUIZA			
29.012	Adidas AG	5.117.976	1,01	33.192	DSM-Firmenich AG	2.815.931	0,56
	Total de Alemania	5.117.976	1,01	10.775	Lonza Group AG - Reg	5.012.942	0,99
				74.603	Nestle SA - Reg	8.460.116	1,67
					Total de Suiza	16.288.989	3,22
HONG KONG				TAIWÁN			
648.600	AIA Group Limited	5.287.792	1,04	635.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	10.287.949	2,03
	Total de Hong Kong	5.287.792	1,04		Total de Taiwán	10.287.949	2,03
INDIA				REINO UNIDO			
742.863	HDFC Bank Limited	13.653.602	2,69	123.978	Anglo American plc	3.428.185	0,68
	Total de India	13.653.602	2,69	74.863	Ashtead Group plc	4.570.529	0,90
				138.982	Diageo plc	5.146.710	1,01
				314.855	Shell plc	10.014.761	1,97
					Total de Reino Unido	23.160.185	4,56
INDONESIA				ESTADOS UNIDOS			
22.937.574	Bank Rakyat Indonesia	7.754.219	1,53	48.580	Abbott Laboratories	4.704.973	0,93
	Total de Indonesia	7.754.219	1,53	11.648	Adobe Systems Inc.	5.939.315	1,17
				47.282	Advanced Micro Devices Inc.	4.861.535	0,96
				131.918	Alphabet Inc. - A	17.262.789	3,40
				142.433	Amazon.com Inc.	18.106.083	3,57
IRLANDA							
163.096	CRH plc	9.041.615	1,78				
23.932	Linde plc	8.911.081	1,76				
	Total de Irlanda	17.952.696	3,54				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Select

Estado de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Renta variable (continuación)				Fondos			
ESTADOS UNIDOS (continuación)				IRLANDA			
22.507	Autodesk Inc.	4.656.923	0,92	4.035.643	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	4.035.643	0,80
10.418	Cooper Companies Inc.	3.313.028	0,65				
33.858	Crowdstrike Holdings Inc. - A	5.667.152	1,12		Total de Irlanda	4.035.643	0,80
44.188	Dexcom Inc.	4.122.740	0,81				
50.218	Ecolab Inc.	8.506.929	1,68		Total de fondos	4.035.643	0,80
54.822	Electronic Arts Inc.	6.600.569	1,30		Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	4.035.643	0,80
23.350	Elevance Health Inc.	10.167.057	2,01		Valor total de las inversiones	501.806.964	98,94
16.287	Eli Lilly & Company	8.748.236	1,72				
6.805	Equinix Inc.	4.942.199	0,97		(Coste total: 449.643.257 USD)		
38.619	Hess Corp.	5.908.707	1,16				
10.573	Humana Inc.	5.143.976	1,01				
70.335	IntercontinentalExchange Inc.	7.738.257	1,53				
17.350	Intuit Inc.	8.864.809	1,75				
59.058	JPMorgan Chase & Company	8.564.591	1,69				
7.985	Lam Research Corp.	5.004.758	0,99				
101.640	Marvell Technology Inc.	5.501.773	1,08				
44.288	Mastercard Inc. - A	17.534.062	3,46				
3.762	Mercadolibre Inc.	4.769.765	0,94				
130.265	Micron Technology Inc.	8.861.928	1,75				
98.694	Microsoft Corp.	31.162.632	6,14				
83.940	NextEra Energy Inc.	4.808.923	0,95				
35.549	Nvidia Corp.	15.463.459	3,04				
50.045	ON Semiconductor Corp.	4.651.683	0,92				
44.284	PepsiCo Inc.	7.503.481	1,48				
62.075	Qualcomm Inc.	6.894.050	1,36				
13.958	Thermo Fisher Scientific Inc.	7.065.121	1,40				
97.133	T-Mobile USA Inc.	13.603.477	2,68				
128.336	Trimble Inc.	6.912.177	1,36				
171.092	Uber Technologies Inc.	7.868.521	1,55				
38.544	Union Pacific Corp.	7.848.715	1,55				
31.155	Zoetis Inc.	5.420.347	1,07				
	Total de Estados Unidos	304.694.740	60,07				
	Total de renta variable	497.771.321	98,14				
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	497.771.321	98,14				

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2023

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
BÉLGICA				ESPAÑA			
876.998	Azelis Group NV	16.408.633	0,98	1.072.858	Fluidra SA	20.781.259	1,24
1.576	Lotus Bakeries NV	12.119.440	0,72	226.941	Viscofan SA	13.117.190	0,78
	Total de Bélgica	28.528.073	1,70		Total de España	33.898.449	2,02
CANADÁ				SUECIA			
396.579	Cargojet Inc.	24.945.666	1,49	2.919.211	Fortnox AB	14.821.260	0,88
	Total de Canadá	24.945.666	1,49	582.183	Hemnet Group AB	9.763.343	0,58
				548.665	MIPS AB	17.686.983	1,05
FRANCIA				SUIZA			
328.231	Lectra	8.451.948	0,50	1.128.799	Nordnet AB	14.170.677	0,84
162.852	Remy Cointreau	18.833.834	1,12	367.730	Thule Group AB	9.172.049	0,55
	Total de Francia	27.285.782	1,62		Total de Suecia	65.614.312	3,90
ALEMANIA				REINO UNIDO			
504.230	CTS Eventim AG	27.152.786	1,62	1.427.163	Auction Technology Group plc	10.743.577	0,64
424.424	Nemetschek SE	24.565.661	1,46	261.417	Games Workshop Group plc	31.854.513	1,90
29.082	Rational AG	17.449.200	1,04	730.608	Genus plc	17.653.786	1,05
212.278	Schott Pharma AG & Company KGaA	6.716.476	0,40	252.804	Renishaw plc	10.264.444	0,61
	Total de Alemania	75.884.123	4,52		Total de Reino Unido	70.516.320	4,20
ITALIA				ESTADOS UNIDOS			
872.637	Fincombank Banca Fineco SpA	10.048.415	0,60	528.263	Aaon Inc.	28.375.269	1,69
3.008.824	Technoprobe SpA	22.415.739	1,33	488.576	Acushnet Holdings Corp.	24.476.100	1,46
	Total de Italia	32.464.154	1,93	241.545	Advanced Drainage Systems	25.969.367	1,55
JAPÓN				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
1.349.900	Asahi Intecc Company Limited	22.966.555	1,37	607.566	Altair Engineering Inc.	35.900.192	2,14
366.300	Capcom Company Limited	12.484.973	0,74	373.696	Armstrong World Industries Inc.	25.413.093	1,51
798.500	Daiseki Company Limited	20.216.217	1,20	697.670	Avient Corp.	23.274.337	1,39
226.100	Gmo Payment Gateway Inc.	11.701.985	0,70	93.909	Axcelis Technologies Inc.	14.462.208	0,86
2.309.300	Japan Elevator Service Holdings Company Limited	32.083.362	1,91	174.950	Blackline Inc.	9.165.975	0,55
213.435	Jtower Inc.	8.308.177	0,49	578.930	Bruker Corp.	34.065.963	2,03
894.740	Shoei Company Limited	12.963.063	0,77	351.043	Casella Waste Systems Inc. - A	25.298.305	1,51
1.567.100	SMS Company Limited	25.248.455	1,50	763.631	Certara Inc.	10.487.079	0,62
	Total de Japón	145.972.787	8,68	206.774	Clean Harbors Inc.	32.685.429	1,94
PAÍSES BAJOS				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
247.234	BE Semiconductor Industries	22.992.762	1,37	310.875	Conmed Corp.	29.612.037	1,76
253.744	IMCD NV	30.449.280	1,81	380.490	Doximity Inc.	7.625.972	0,45
	Total de Países Bajos	53.442.042	3,18	289.384	Esab Corp.	19.192.958	1,14

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies

Estado de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Renta variable (continuación)				Fondos			
ESTADOS UNIDOS (continuación)				IRLANDA			
1.039.637	Flywire Corp.	31.314.309	1,86	51.046.863	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	48.214.274	2,87
327.609	Freshpet Inc.	20.385.248	1,21				
244.526	Hamilton Lane Inc.	20.887.774	1,25		Total de Irlanda	48.214.274	2,87
906.319	Intapp Inc.	28.694.038	1,71				
165.891	Kadant Inc.	35.340.463	2,10		Total de fondos	48.214.274	2,87
121.443	Lattice Semiconductor Corp.	9.856.526	0,59				
1.305.179	Levi Strauss & Company	16.740.808	1,00		Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	48.214.274	2,87
545.230	Live Oak Bancshares Inc.	14.908.532	0,89				
158.085	MSA Safety Inc.	23.539.174	1,40		Valor total de las inversiones	1.683.404.846	100,23
1.373.017	Neogen Corp.	24.043.197	1,43				
79.456	Novanta Inc.	10.764.740	0,64				
179.876	Power Integrations Inc.	12.964.664	0,77				
182.424	Quaker Chemical Corp.	27.568.208	1,64				
141.675	Repligen Corp.	21.277.678	1,27				
377.591	Ryman Hospitality Properties Inc.	29.700.853	1,77				
181.021	Simpson Manufacturing Company Inc.	25.613.937	1,53				
186.552	SiteOne Landscape Supply Inc.	28.799.929	1,71				
226.034	SiTime Corp.	24.391.390	1,46				
176.665	SPS Commerce Inc.	28.468.303	1,70				
437.355	SPX Technologies Inc.	33.625.215	2,01				
35.684	TopBuild Corp.	8.479.900	0,50				
291.657	Triumph Financial Inc.	17.847.894	1,06				
136.768	Visteon Corp.	17.835.710	1,06				
545.508	Vita Coco Company Inc.	13.416.792	0,80				
95.423	WD-40 Company	18.317.611	1,09				
869.091	WillScot Mobile Mini Holdings Corp.	34.139.783	2,04				
370.601	Workiva Inc.	35.472.685	2,11				
	Total de Estados Unidos	960.399.645	57,20				
	Total de renta variable	1.635.190.572	97,36				
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	1.635.190.572	97,36				

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - American

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2023

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
ISLAS CAIMÁN				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
384.065	Globalfoundries Inc.	22.348.742	2,24	162.362	JM Smucker Company	19.955.913	1,99
	Total de Islas Caimán	22.348.742	2,24	40.984	Lam Research Corp.	25.687.541	2,57
CURAZAO				426.693	Marvell Technology Inc.	23.096.891	2,31
225.077	Schlumberger Limited	13.121.989	1,31	173.313	Microchip Technology Inc.	13.527.080	1,35
	Total de Curazao	13.121.989	1,31	90.111	Microsoft Corp.	28.452.548	2,84
IRLANDA				111.643	Nike Inc.	10.675.304	1,07
54.536	Accenture plc	16.748.551	1,68	317.424	Northern Trust Corp.	22.054.619	2,21
	Total de Irlanda	16.748.551	1,68	1.795.053	NOV Inc.	37.516.608	3,76
SUIZA				162.470	Procter & Gamble Company	23.697.874	2,37
229.369	TE Connectivity Limited	28.333.953	2,83	189.638	Prologis Inc.	21.279.280	2,13
	Total de Suiza	28.333.953	2,83	197.410	Qualcomm Inc.	21.924.355	2,19
ESTADOS UNIDOS				80.914	Republic Services Inc.	11.531.054	1,15
132.938	Advanced Micro Devices Inc.	13.668.685	1,37	30.075	S&P Global Inc.	10.989.706	1,10
107.107	Agilent Technologies Inc.	11.976.705	1,20	78.060	Salesforce.com Inc.	15.829.007	1,58
53.152	Alnylam Pharmaceuticals Inc.	9.413.219	0,94	96.172	Sherwin-Williams Company	24.528.668	2,45
141.448	Alphabet Inc. - A	18.509.885	1,85	195.427	Stanley Black & Decker Inc.	16.333.789	1,63
278.445	Amazon.com Inc.	35.395.928	3,54	79.390	Take-Two Interactive Software Inc.	11.145.562	1,12
343.693	Baxter International Inc.	12.970.974	1,30	69.310	Transunion	4.975.765	0,50
29.543	Becton Dickinson & Company	7.637.752	0,76	172.448	Trimble Inc.	9.288.049	0,93
92.038	BioMarin Pharmaceuticals Inc.	8.143.522	0,81	235.435	Uber Technologies Inc.	10.827.656	1,08
137.443	Boston Properties Inc.	8.175.110	0,82	44.826	Union Pacific Corp.	9.127.918	0,91
473.936	Bristol-Myers Squibb Company	27.507.246	2,75	92.865	United Parcel Service Inc.	14.474.868	1,45
27.143	Broadcom Inc.	22.544.433	2,26	61.622	Vertex Pharmaceuticals Inc.	21.428.435	2,15
102.549	Burlington Stores Inc.	13.874.880	1,39	385.801	Voya Financial Inc.	25.636.476	2,57
276.540	Catalent Inc.	12.590.866	1,26	245.510	Walt Disney Company	19.898.586	1,99
243.407	Charles Schwab Corp.	13.363.044	1,34	390.698	WillScot Mobile Mini Holdings Corp.	16.249.130	1,63
396.559	Coca Cola Company	22.199.373	2,22	48.500	Zebra Technologies Corp.	11.471.705	1,15
68.429	CrowdStrike Holdings Inc. - A	11.453.646	1,15		Total de Estados Unidos	906.725.080	90,72
225.615	Darling International Inc.	11.777.103	1,18		Total de renta variable	987.278.315	98,78
86.478	Electronic Arts Inc.	10.411.951	1,04		Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	987.278.315	98,78
46.634	Eli Lilly & Company	25.048.520	2,51				
465.062	Endeavor Group Holdings Inc.	9.254.734	0,93				
83.516	FMC Corp.	5.593.067	0,56				
126.996	Global Payments Inc.	14.654.068	1,46				
35.029	Goldman Sachs Group Inc.	11.334.334	1,13				
75.856	Hess Corp.	11.605.968	1,16				
187.767	Hilton Worldwide Holdings Inc.	28.198.848	2,82				
123.358	Howmet Aerospace Inc.	5.705.308	0,57				
122.586	IntercontinentalExchange Inc.	13.486.912	1,35				
108.436	International Flavors & Fragrances Inc.	7.392.082	0,74				
72.642	Intuitive Surgical Inc.	21.232.530	2,13				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - American

Estado de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
9.764.502	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	9.764.502	0,98
	Total de Irlanda	9.764.502	0,98
	Total de fondos	9.764.502	0,98
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	9.764.502	0,98
	Valor total de las inversiones	997.042.817	99,76
	(Coste total: 943.622.873 USD)		

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - American Select

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2023

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Renta variable				Renta variable (continuación)					
CANADÁ				ESTADOS UNIDOS (continuación)					
39.257	RB Global Inc.	2.453.563	0,78	42.910	Transunion	3.080.509	0,98		
	Total de Canadá	2.453.563	0,78	62.597	Trimble Inc.	3.371.474	1,07		
ISLAS CAIMÁN				106.328	Uber Technologies Inc.	4.890.025	1,56		
148.852	Globalfoundries Inc.	8.661.698	2,76	38.078	United Parcel Service Inc.	5.935.218	1,89		
	Total de Islas Caimán	8.661.698	2,76	48.184	Vertex Pharmaceuticals Inc.	16.755.505	5,35		
IRLANDA				101.609	Walt Disney Company	8.235.409	2,62		
19.037	Accenture plc	5.846.453	1,86	121.866	WillScot Mobile Mini Holdings Corp.	5.068.407	1,61		
	Total de Irlanda	5.846.453	1,86	13.972	Zebra Technologies Corp.	3.304.797	1,05		
ESTADOS UNIDOS				Total de Estados Unidos					
40.917	Advanced Micro Devices Inc.	4.207.086	1,34				290.087.544	92,39	
60.390	Agilent Technologies Inc.	6.752.810	2,15	Total de renta variable				307.049.258	97,79
24.298	Alnylam Pharmaceuticals Inc.	4.303.176	1,37	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				307.049.258	97,79
44.666	Alphabet Inc. - A	5.844.993	1,86	Valor total de las inversiones				307.049.258	97,79
94.045	Amazon.com Inc.	11.955.000	3,80	(Coste total: 298.442.446 USD)					
11.850	Becton Dickinson & Company	3.063.581	0,98	<i>* Diferencias menores debido al redondeo.</i>					
48.718	BioMarin Pharmaceuticals Inc.	4.310.569	1,37						
44.461	Boston Properties Inc.	2.644.540	0,84						
41.518	Burlington Stores Inc.	5.617.385	1,79						
134.362	Catalent Inc.	6.117.502	1,95						
189.931	Charles Schwab Corp.	10.427.212	3,32						
223.528	Coca Cola Company	12.513.097	3,99						
42.999	CrowdStrike Holdings Inc. - A	7.197.173	2,29						
61.238	Darling International Inc.	3.196.624	1,02						
50.108	Electronic Arts Inc.	6.033.003	1,92						
81.450	Global Payments Inc.	9.398.515	2,99						
20.288	Goldman Sachs Group Inc.	6.564.588	2,09						
23.186	Hess Corp.	3.547.458	1,13						
58.113	Hilton Worldwide Holdings Inc.	8.727.410	2,78						
21.966	Intuitive Surgical Inc.	6.420.442	2,04						
57.520	JM Smucker Company	7.069.783	2,25						
25.547	Lam Research Corp.	16.012.092	5,11						
109.306	Marvell Technology Inc.	5.916.734	1,88						
31.218	Microsoft Corp.	9.857.083	3,14						
43.011	Nike Inc.	4.112.712	1,31						
703.679	NOV Inc.	14.706.891	4,68						
69.831	Procter & Gamble Company	10.185.550	3,24						
58.507	Prologis Inc.	6.565.071	2,09						
125.410	Qualcomm Inc.	13.928.035	4,44						
19.464	S&P Global Inc.	7.112.340	2,27						
92.035	Schnitzer Steel Industries Inc.	2.563.175	0,82						
29.641	Sherwin-Williams Company	7.559.937	2,41						
59.998	Stanley Black & Decker Inc.	5.014.633	1,60						

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2023

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
BERMUDAS				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
200.767	Axalta Coating System Limited	5.400.632	0,95	67.520	Impinj Inc.	3.715.626	0,65
240.049	Essent Group Limited	11.351.917	2,00	124.352	Insmed Inc.	3.139.888	0,55
	Total de Bermudas	16.752.549	2,95	296.840	Kontoor Brands Inc.	13.034.245	2,30
				378.309	Latham Group Inc.	1.059.265	0,19
				276.282	Livent Corp.	5.086.352	0,90
				624.859	Liveperson Inc.	2.430.702	0,43
				557.044	Lyft Inc. - A	5.871.244	1,03
				311.369	Matthews International Corp. - A	12.115.368	2,13
				20.406	Medpace Holdings Inc.	4.940.905	0,87
				270.602	Moelis & Company - A	12.212.268	2,15
				79.588	Morningstar Inc.	18.642.692	3,27
				172.346	nCino Inc.	5.480.603	0,97
				559.530	Newell Brands Inc.	5.052.556	0,89
				1.950.695	Newpark Resources	13.479.301	2,37
				143.837	NLight Inc.	1.495.905	0,26
				765.484	NOV Inc.	15.998.615	2,81
				274.400	Nutanix Inc. - A	9.571.071	1,68
				252.018	Patterson Companies Inc.	7.469.814	1,32
				68.258	Qualys Inc.	10.412.758	1,84
				342.623	Quanex Building Products Corp.	9.651.690	1,70
				207.372	Quanterix Corp.	5.628.076	0,99
				1.089.852	Ranpak Holdings Corp.	5.928.795	1,04
				53.959	Rapid7 Inc.	2.470.243	0,43
				239.077	Revolution Medicines Inc.	6.617.651	1,18
				27.010	Rogers Corp.	3.551.005	0,63
				155.889	Sage Therapeutics Inc.	3.208.196	0,56
				311.628	Schnitzer Steel Industries Inc.	8.678.840	1,53
				90.518	Shift4 Payments Inc.	5.011.982	0,88
				79.051	Simulations Plus Inc.	3.296.427	0,58
				70.852	SiTime Corp.	8.094.841	1,43
				60.305	Stanley Black & Decker Inc.	5.040.292	0,89
				116.617	Teradata Corp.	5.250.097	0,92
				414.341	Utz Brands Inc.	5.564.600	0,98
				457.467	Virtu Financial Inc.	7.900.455	1,39
				208.654	Voya Financial Inc.	13.865.059	2,44
				317.832	WillScot Mobile Mini Holdings Corp.	13.218.633	2,32
				34.099	Wingstop Inc.	6.132.364	1,08
					Total de Estados Unidos	529.246.375	93,20
					Total de renta variable	558.686.253	98,38
					Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	558.686.253	98,38

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies

Estado de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario			
Renta variable			
JERSEY - ISLAS DEL CANAL			
822.025	Clarivate Analytics plc	5.515.788	0,97
	Total de Jersey - Islas del Canal	5.515.788	0,97
	Total de renta variable	5.515.788	0,97
	Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario	5.515.788	0,97
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
2.538.085	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	2.538.085	0,45
	Total de Irlanda	2.538.085	0,45
	Total de fondos	2.538.085	0,45
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	2.538.085	0,45
	Valor total de las inversiones	566.740.126	99,80
(Coste total: 577.393.711 USD)			

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity

Estado de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)			
TAILANDIA			
29.200	CP All pcl	48.516	0,53
	Total de Tailandia	48.516	0,53
	Total de renta variable	8.954.468	97,33
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	8.954.468	97,33
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
9.017	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	9.017	0,10
	Total de Irlanda	9.017	0,10
	Total de fondos	9.017	0,10
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	9.017	0,10
	Valor total de las inversiones	8.963.485	97,43
	(Coste total: 9.510.978 USD)		

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Asia Equities

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2023

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
AUSTRALIA				HONG KONG (continuación)			
130.830	ANZ Group Holdings Limited	2.166.671	2,14	1.056.000	Lenovo Group Limited	1.088.113	1,07
154.379	Chalice Mining Limited	231.156	0,23	85.661	Techtronic Industries Company	831.253	0,82
7.587	CSL Limited	1.228.080	1,21	Total de Hong Kong			
758.760	Deterra Royalties Limited	2.345.681	2,32	7.503.487 7,41			
139.958	Goodman Group	1.937.555	1,91	INDIA			
121.316	IGO Limited	991.244	0,98	136.529	Bharti Airtel Limited	1.523.078	1,50
13.779	Macquarie Group Limited	1.491.617	1,48	131.132	HDFC Bank Limited	2.410.167	2,38
20.376	Mineral Resources Limited	889.380	0,88	286.116	ICICI Bank Limited	3.279.686	3,24
410.382	Santos Limited	2.092.398	2,07	55.867	IndusInd Bank Limited	961.259	0,95
390.836	Telstra Group Limited	971.145	0,96	90.744	Infosys Limited	1.568.573	1,55
166.215	Transurban Group	1.361.322	1,34	107.198	Jio Financial Services Limited	298.451	0,29
106.490	Worley Limited	1.196.566	1,18	47.656	Larsen & Toubro Limited	1.735.135	1,72
Total de Australia		16.902.815	16,70	75.512	Mahindra & Mahindra Limited	1.413.304	1,40
ISLAS CAIMÁN				121.560	Max Healthcare Institute Limited	830.574	0,82
109.200	Baidu Inc. - A	1.860.009	1,84	107.198	Reliance Industries Limited	3.027.110	2,99
376.816	China Resources Land Limited	1.501.137	1,48	Total de India			
73.193	Meituan	1.071.003	1,06	17.047.337 16,84			
66.200	NetEase Inc.	1.348.203	1,33	INDONESIA			
119.300	Shenzhou International Group Holdings Limited	1.142.453	1,13	2.552.700	Bank Central Asia Tbk PT	1.457.534	1,44
111.100	Tencent Holdings Limited	4.343.658	4,29	7.008.156	Bank Rakyat Indonesia	2.369.160	2,34
37.850	Trip.com Group Limited	1.349.329	1,33	Total de Indonesia			
37.000	Wuxi Biologics Cayman Inc.	215.665	0,21	3.826.694 3,78			
Total de Islas Caimán		12.831.457	12,67	LUXEMBURGO			
CHINA				273.000	Samsonite International SA	937.673	0,93
294.028	Alibaba Group Holding Limited	3.213.653	3,17	Total de Luxemburgo			
190.100	Inner Mongolia Yili Industrial Group Company Limited - A	692.220	0,68	937.673 0,93			
294.600	NARI Technology Company Limited	897.253	0,89	FILIPINAS			
223.500	Ping An Insurance Group Company of China Limited	1.279.901	1,26	489.160	BDO Unibank Inc.	1.226.854	1,21
94.800	Shenzhen Inovance Technology Company Limited	865.147	0,85	571.235	Metropolitan Bank & Trust	545.215	0,54
26.177	Wuliangye Yibin Company Limited - A	560.851	0,55	Total de Filipinas			
Total de China		7.509.025	7,40	1.772.069 1,75			
HONG KONG				REPÚBLICA DE COREA (SUR)			
297.400	AIA Group Limited	2.424.590	2,40	45.573	KT Corp.	1.119.568	1,11
326.000	Galaxy Entertainment Group Limited	1.962.618	1,94	7.056	Naver Corp.	1.053.641	1,04
32.037	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	1.196.913	1,18	1.141	Posco Holdings Inc.	452.375	0,45
				1.718	Samsung Biologics Company Limited	867.021	0,86
				121.904	Samsung Electronics Company Limited	6.179.214	6,11
				27.089	SK hynix Inc.	2.302.585	2,27
				Total de República de Corea (Sur)			
				11.974.404 11,84			

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Asia Equities

Estado de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)			
SINGAPUR			
61.600	DBS Group Holdings Limited	1.518.223	1,50
305.800	Keppel Corp. Limited	1.523.510	1,50
330.400	Sembcorp Industries Limited	1.232.131	1,21
	Total de Singapur	4.273.864	4,21
TAIWÁN			
172.000	Chroma ATE Inc.	1.470.587	1,45
150.000	Delta Electronics Inc.	1.507.854	1,49
163.000	E Ink Holdings Inc.	906.370	0,90
12.000	eMemory Technology Inc.	749.048	0,74
512.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	8.295.164	8,20
209.000	Unimicron Technology Corp.	1.123.309	1,11
70.000	Yageo Corp.	1.138.442	1,12
	Total de Taiwán	15.190.774	15,01
ESTADOS UNIDOS			
21.650	Yum China Holdings Inc.	1.221.294	1,21
	Total de Estados Unidos	1.221.294	1,21
	Total de renta variable	100.990.893	99,75
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	100.990.893	99,75
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
1.210	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	1.210	0,00
	Total de Irlanda	1.210	0,00
	Total de fondos	1.210	0,00
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	1.210	0,00
	Valor total de las inversiones	100.992.103	99,75
	(Coste total: 99.313.379 USD)		

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2023

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
CANADÁ				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
59.181	Canadian Natural Resources Limited	3.827.235	1,18	35.265	GE HealthCare Technologies Inc.	2.399.431	0,74
	Total de Canadá	3.827.235	1,18	34.430	General Electric Company	3.806.237	1,17
				15.055	Honeywell International Inc.	2.781.261	0,86
IRLANDA				26.902	IBM Corp.	3.774.350	1,16
11.323	Accenture plc	3.477.407	1,07	11.991	Intuit Inc.	6.126.682	1,88
8.093	Aon plc	2.623.912	0,81	8.976	Iqvia Holdings Inc.	1.766.028	0,54
49.611	Medtronic Inc.	3.887.518	1,19	28.719	JPMorgan Chase & Company	4.164.829	1,28
	Total de Irlanda	9.988.837	3,07	123.948	Kenvue Inc.	2.488.876	0,77
				5.677	Lam Research Corp.	3.558.173	1,09
SUIZA				5.834	Lowe's Companies Inc.	1.212.539	0,37
31.982	TE Connectivity Limited	3.950.736	1,21	25.461	Marvell Technology Inc.	1.378.204	0,42
	Total de Suiza	3.950.736	1,21	13.497	Mastercard Inc. - A	5.343.597	1,64
				37.886	Match Group Inc.	1.484.184	0,46
ESTADOS UNIDOS				1.214	McDonald's Corp.	319.816	0,10
13.420	Abbott Laboratories	1.299.727	0,40	27.312	Meta Platforms Inc.	8.199.336	2,52
34.265	AbbVie Inc.	5.107.541	1,57	71.198	Microsoft Corp.	22.480.768	6,90
7.442	Adobe Systems Inc.	3.794.676	1,17	31.442	Mondelez International Inc.	2.182.075	0,67
16.194	Advanced Micro Devices Inc.	1.665.067	0,51	1.570	MSCI Inc. - A	805.536	0,25
61.839	Alphabet Inc. - A	8.092.252	2,48	58.124	Newmont Corp.	2.147.682	0,66
58.892	Alphabet Inc. - C	7.764.910	2,39	25.768	Nvidia Corp.	11.208.823	3,46
101.457	Amazon.com Inc.	12.897.214	3,96	7.627	Palo Alto Networks Inc.	1.788.074	0,55
5.365	American Express Company	800.404	0,25	12.329	Parker Hannifin Corp.	4.802.392	1,48
22.525	American Tower Corp.	3.704.236	1,14	93.725	Pinterest Inc.	2.533.387	0,78
113.201	Apple Inc.	19.381.143	5,96	29.200	Procter & Gamble Company	4.259.112	1,30
12.659	Avery Dennison Corp.	2.312.420	0,71	32.677	Public Service Enterprise Group Inc.	1.859.648	0,57
64.309	Bank of America Corp.	1.760.780	0,54	20.724	Qualcomm Inc.	2.301.607	0,71
25.552	Berkshire Hathaway Inc.	8.950.866	2,75	60.294	RTX Corp.	4.339.359	1,33
23.803	BioMarin Pharmaceuticals Inc.	2.106.089	0,65	7.226	S&P Global Inc.	2.640.453	0,81
8.159	BlackRock Inc.	5.274.712	1,62	13.850	Sherwin-Williams Company	3.532.443	1,09
43.517	Boston Scientific Corp.	2.297.698	0,71	14.702	Sysco Corp.	971.067	0,30
37.298	Chevron Corp.	6.289.189	1,93	32.881	Take-Two Interactive Software Inc.	4.616.164	1,42
60.254	Comcast Corp.	2.671.662	0,82	68.078	Tapestry Inc.	1.957.243	0,60
148.204	Coty Inc. - A	1.625.798	0,50	18.137	Tesla Inc.	4.538.240	1,40
9.542	Danaher Corp.	2.367.370	0,73	6.378	Thermo Fisher Scientific Inc.	3.228.352	0,99
5.463	Dollar Tree Inc.	581.536	0,18	24.629	T-Mobile USA Inc.	3.449.291	1,06
20.188	DTE Energy Company	2.004.265	0,62	104.554	Uber Technologies Inc.	4.808.438	1,48
11.544	Elevance Health Inc.	5.026.488	1,54	23.099	Union Pacific Corp.	4.703.649	1,45
15.176	Eli Lilly & Company	8.151.485	2,51	8.487	United Health Group Inc.	4.279.061	1,32
36.109	Emerson Electric Company	3.487.046	1,07	11.158	Vertex Pharmaceuticals Inc.	3.880.083	1,19
107.449	Endeavor Group Holdings Inc.	2.138.235	0,66	23.059	Visa Inc. - A	5.303.801	1,63
13.927	Entegris Inc.	1.307.885	0,40	34.987	Walmart Inc.	5.595.470	1,72
26.411	EOG Resources Inc.	3.347.858	1,03	45.631	Wells Fargo & Company	1.864.483	0,57
				6.676	Zebra Technologies Corp.	1.579.074	0,49

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities

Estado de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)			
ESTADOS UNIDOS (continuación)			
74,231	ZoomInfo Technologies Inc.	1.217.388	0,37
	Total de Estados Unidos	293.885.258	90,35
	Total de renta variable	311.652.066	95,81
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	311.652.066	95,81
	Valor total de las inversiones	311.652.066	95,81

(Coste total: 248.163.208 USD)

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2023

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
LIBERIA				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
12.200	Royal Caribbean Cruises Limited	1.124.108	0,71	4.918	Lam Research Corp.	3.082.455	1,94
	Total de Liberia	1.124.108	0,71	15.520	Lennar Corp.	1.741.809	1,10
ESTADOS UNIDOS				5.611	Lockheed Martin Corp.	2.294.675	1,44
21.846	Abbott Laboratories	2.115.785	1,33	16.548	Marathon Petroleum Corp.	2.504.374	1,57
9.895	AbbVie Inc.	1.474.949	0,93	16.405	Marsh & McLennan Companies Inc.	3.121.871	1,97
7.317	Adobe Systems Inc.	3.730.938	2,34	8.375	Masco Corp.	447.644	0,28
7.110	Advanced Micro Devices Inc.	731.050	0,46	5.272	Mastercard Inc. - A	2.087.238	1,31
6.289	Align Technology Inc.	1.920.157	1,21	17.703	Meta Platforms Inc.	5.314.617	3,34
67.253	Alphabet Inc. - A	8.800.728	5,53	29.712	Metlife Inc.	1.869.182	1,17
66.174	Altria Group Inc.	2.782.617	1,75	17.696	MGM Resorts International	650.505	0,41
21.409	Amazon.com Inc.	2.721.512	1,71	31.260	Microsoft Corp.	9.870.345	6,19
26.779	American Electric Power Company Inc.	2.014.316	1,27	25.747	Morgan Stanley	2.102.757	1,32
1.137	Amgen Inc.	305.580	0,19	33.403	Mosaic Company	1.189.147	0,74
67.058	Apple Inc.	11.481.001	7,22	4.643	Nucor Corp.	725.933	0,46
2.549	Applied Materials Inc.	352.909	0,22	7.565	Nvidia Corp.	3.290.699	2,07
33.024	Archer-Daniels-Midland Company	2.490.670	1,56	1.392	O'Reilly Automotive Inc.	1.265.133	0,79
13.299	Autodesk Inc.	2.751.696	1,73	6.590	Parker Hannifin Corp.	2.566.937	1,61
11.946	Automatic Data Processing Inc.	2.873.968	1,81	18.821	Pfizer Inc.	624.293	0,39
12.256	Best Buy Company Inc.	851.424	0,53	14.800	PG&E Corp.	238.724	0,15
5.025	BioMarin Pharmaceuticals Inc.	444.612	0,28	3.036	Procter & Gamble Company	442.831	0,28
629	Booking Holdings Inc.	1.939.805	1,22	17.932	PulteGroup Inc.	1.327.865	0,83
52.854	Bristol-Myers Squibb Company	3.067.646	1,93	23.859	Qualcomm Inc.	2.649.781	1,66
29.781	Cardinal Health Inc.	2.585.586	1,62	1.108	Regeneron Pharmaceuticals Inc.	911.840	0,57
9.530	Caterpillar Inc.	2.601.690	1,63	12.239	SBA Communications	2.449.881	1,54
10.884	CF Industries Holdings Inc.	933.194	0,59	35.285	State Street Corp.	2.362.684	1,48
69.554	Cisco Systems Inc.	3.739.223	2,35	12.900	Steel Dynamics Inc.	1.383.138	0,87
45.080	Citigroup Inc.	1.854.140	1,17	32.996	Synchrony Financial	1.008.688	0,63
4.310	CME Group Inc.	862.948	0,54	5.860	Tesla Inc.	1.466.289	0,92
3.339	CVS Health Corp.	233.129	0,15	16.122	TJX Companies Inc.	1.432.923	0,90
47.100	Ebay Inc.	2.076.639	1,30	17.043	Valero Energy Corp.	2.415.164	1,52
2.071	Electronic Arts Inc.	249.348	0,16	2.739	Vertex Pharmaceuticals Inc.	952.460	0,60
20.540	Evergy Inc.	1.041.378	0,65	173.915	Viatis Inc.	1.714.802	1,08
3.530	Expedia Group Inc.	363.837	0,23	7.135	Visa Inc. - A	1.641.121	1,04
21.981	Exxon Mobil Corp.	2.584.526	1,63	22.754	Walmart Inc.	3.639.048	2,29
8.575	Fedex Corp.	2.271.689	1,43	38.193	Wells Fargo & Company	1.560.566	0,98
7.600	Fiserv Inc.	858.496	0,54		Total de Estados Unidos	155.924.248	97,97
31.861	Fortinet Inc.	1.869.603	1,17		Total de renta variable	157.048.356	98,68
9.332	Fox Corp.	291.158	0,18		Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	157.048.356	98,68
10.442	General Mills Inc.	668.184	0,42		Valor total de las inversiones	157.048.356	98,68
29.243	Hologic Inc.	2.029.465	1,27		(Coste total: 149.037.714 USD)		
48.345	Host Hotels & Resorts Inc.	776.904	0,49				
5.350	Humana Inc.	2.602.882	1,64				
5.172	Kroger Company	231.447	0,15				

* Diferencias menores debido al redondeo.

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2023

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
BÉLGICA				ITALIA (continuación)			
71.976	KBC Group NV	4.256.661	0,88				
	Total de Bélgica	4.256.661	0,88				
DINAMARCA				ITALIA			
28.321	DSV A/S	5.009.452	1,03	105.776	Moncler SpA	5.826.142	1,20
319.480	Novo Nordisk A/S	27.586.647	5,68		Total de Italia	5.826.142	1,20
	Total de Dinamarca	32.596.099	6,71				
FRANCIA				PAÍSES BAJOS			
52.292	Air Liquide SA	8.358.354	1,72	15.131	ASM International NV	6.014.573	1,24
379.180	AXA SA	10.685.292	2,20	33.597	ASML Holding NV	18.784.082	3,86
141.652	BNP Paribas SA	8.560.030	1,76	552.240	ING Groep NV	6.930.612	1,43
141.689	Compagnie de Saint-Gobain	8.059.270	1,66	128.594	STMicroelectronics NV	5.270.425	1,08
41.963	EssilorLuxottica SA	6.930.609	1,43		Total de Países Bajos	36.999.692	7,61
4.629	Hermes International	8.007.244	1,65				
39.894	L'Oreal SA	15.686.321	3,23				
24.848	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	17.801.107	3,66				
57.068	Pernod-Ricard SA	9.008.184	1,85				
109.834	Publicis Groupe SA	7.881.688	1,62				
59.506	Schneider Electric SE	9.341.252	1,92				
334.959	TotalEnergies SE	20.871.295	4,29				
63.322	Vinci SA	6.650.076	1,37				
	Total de Francia	137.840.722	28,36				
ALEMANIA				NORUEGA			
69.315	Brenntag SE	5.093.266	1,05	417.072	DNB Bank ASA	7.981.563	1,64
152.358	Daimler Truck Holding AG	5.000.390	1,03		Total de Noruega	7.981.563	1,64
529.104	Deutsche Telekom AG - Reg	10.512.238	2,16				
89.598	Dr Ing hc F Porsche AG	7.974.221	1,64				
89.331	Mercedes-Benz Group AG - Reg	5.886.020	1,21				
29.579	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG - Reg	10.917.609	2,24				
34.470	Siemens AG - Reg	4.676.200	0,96				
	Total de Alemania	50.059.944	10,29				
IRLANDA				ESPAÑA			
740.266	Bank of Ireland Group plc	6.877.071	1,41	318.924	EDP Renovaveis SA	4.948.106	1,02
189.038	CRH plc	9.898.250	2,03	193.164	Inditex SA	6.816.758	1,40
137.032	Experian plc	4.251.066	0,87		Total de España	11.764.864	2,42
	Total de Irlanda	21.026.387	4,31				
				SUECIA			
				236.498	Atlas Copco AB	3.027.538	0,62
				285.763	Sandvik AB	5.008.449	1,03
					Total de Suecia	8.035.987	1,65
				SUIZA			
				81.385	Compagnie Financiere Richemont SA - Reg	9.411.151	1,94
				13.047	Lonza Group AG - Reg	5.733.141	1,18
				198.391	Nestle SA - Reg	21.249.494	4,37
				61.354	Roche Holding AG	15.865.154	3,26
				31.249	Sika AG	7.520.709	1,55
				396.578	UBS Group AG	9.290.594	1,91
					Total de Suiza	69.070.243	14,21
				REINO UNIDO			
				736.470	3i Group plc	17.600.156	3,63
				210.095	Ashtead Group plc	12.114.948	2,50
				150.191	Astrazeneca plc	19.222.386	3,95
				401.018	Compass Group	9.246.045	1,90
				714.243	Howden Joinery Group plc	6.063.480	1,25

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities

Estado de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)			
REINO UNIDO (continuación)			
56.578	London Stock Exchange Group plc	5.370.573	1,10
160.963	Reckitt Benckiser Group plc	10.751.442	2,21
78.380	Rio Tinto plc	4.675.132	0,96
533.718	SSE plc	9.906.035	2,04
	Total de Reino Unido	94.950.197	19,54
	Total de renta variable	480.408.501	98,82
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	480.408.501	98,82
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
36.373	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	3.655.824	0,75
	Total de Irlanda	3.655.824	0,75
	Total de fondos	3.655.824	0,75
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	3.655.824	0,75
	Valor total de las inversiones	484.064.325	99,57

(Coste total: 423.366.581 EUR)

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2023

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
BÉLGICA				ITALIA (continuación)			
13.318	KBC Ancora	515.407	0,96	189.242	Finecobank Banca Fineco SpA	2.179.121	4,04
17.569	KBC Group NV	1.039.031	1,93	171.757	Nexi SpA	994.130	1,84
9.647	Melexis NV	788.160	1,46				
	Total de Bélgica	2.342.598	4,35		Total de Italia	5.558.066	10,31
DINAMARCA				JERSEY - ISLAS DEL CANAL			
8.488	Novo Nordisk A/S	732.927	1,36	96.531	WPP plc	815.705	1,51
79.777	Tryg A/S	1.383.824	2,57				
	Total de Dinamarca	2.116.751	3,93		Total de Jersey - Islas del Canal	815.705	1,51
FINLANDIA				PAÍSES BAJOS			
39.559	Upm-Kymmene Oyj	1.284.481	2,38	2.979	ASM International NV	1.184.152	2,20
	Total de Finlandia	1.284.481	2,38	10.819	BE Semiconductor Industries	1.006.167	1,87
				422.563	Royal KPN NV	1.317.974	2,45
					Total de Países Bajos	3.508.293	6,52
FRANCIA				NORUEGA			
8.344	Air Liquide SA	1.333.705	2,48	69.877	TGS ASA	909.277	1,69
64.011	Antin Infrastructure Partners SA	782.855	1,45				
62.479	AXA SA	1.760.658	3,26		Total de Noruega	909.277	1,69
5.348	BNP Paribas SA	323.180	0,60				
14.699	Compagnie de Saint-Gobain	836.079	1,55				
1.783	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	1.277.341	2,37				
7.110	Schneider Electric SE	1.116.128	2,07				
23.762	TotalEnergies SE	1.480.610	2,75				
10.910	Vinci SA	1.145.768	2,13				
	Total de Francia	10.056.324	18,66				
ALEMANIA				ESPAÑA			
34.586	Daimler Truck Holding AG	1.135.113	2,10	117.610	Iberdrola SA	1.246.078	2,31
89.886	Deutsche Telekom AG - Reg	1.785.855	3,31	32.118	Inditex SA	1.133.444	2,10
8.660	Mercedes-Benz Group AG - Reg	570.607	1,06				
9.237	SAP SE	1.134.488	2,10		Total de España	2.379.522	4,41
8.301	Siemens AG - Reg	1.126.114	2,09				
	Total de Alemania	5.752.177	10,66				
IRLANDA				SUIZA			
119.268	Bank of Ireland Group plc	1.108.000	2,06	1.128	Burckhardt Compression Holding AG	581.735	1,08
29.578	CRH plc	1.548.739	2,87	1.513	Lonza Group AG - Reg	664.846	1,23
16.724	Smurfit Kappa Group plc	526.338	0,98	8.654	Nestle SA - Reg	926.923	1,72
	Total de Irlanda	3.183.077	5,91	910	Partners Group Holding AG - Reg	971.969	1,80
				5.224	Roche Holding AG	1.350.842	2,51
					Total de Suiza	4.496.315	8,34
ITALIA				REINO UNIDO			
409.762	Enel SpA	2.384.815	4,43	63.082	3i Group plc	1.507.533	2,80
				186.642	Allfunds Group plc	978.004	1,81
				27.077	Anglo American plc	707.175	1,31
				20.131	Ashtead Group plc	1.160.836	2,16
				13.359	Astrazeneca plc	1.709.768	3,17
				21.922	Diageo plc	766.757	1,42
				7.612	London Stock Exchange Group plc	722.556	1,34
				8.571	Reckitt Benckiser Group plc	572.496	1,06
				75.039	SSE plc	1.392.756	2,59

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend

Estado de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)			
REINO UNIDO (continuación)			
1.075.962	Vodafone Group plc	952.869	1,77
	Total de Reino Unido	10.470.750	19,43
	Total de renta variable	52.873.336	98,10
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	52.873.336	98,10
	Valor total de las inversiones	52.873.336	98,10

(Coste total: 51.730.230 EUR)

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2023

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
BÉLGICA				ISLA DE MAN			
170.840	Azelis Group NV	3.196.416	0,94	501.093	Strix Group plc	305.010	0,09
260	Lotus Bakeries NV	1.999.400	0,59				
88.430	Melexis NV	7.224.731	2,12		Total de Isla de Man	305.010	0,09
	Total de Bélgica	12.420.547	3,65				
FINLANDIA				ITALIA			
164.851	Huhtamaki Oyj	5.135.109	1,50	368.729	Carel Industries SpA	8.370.148	2,45
108.398	Konecranes Oyj	3.410.201	1,00	20.001	Diasorin SpA	1.728.486	0,51
112.938	Musti Group Oyj	2.032.884	0,60	209.197	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	2.356.604	0,69
111.353	Vaisala Oyj	3.696.920	1,08	126.333	Interpump Group SpA	5.494.222	1,61
	Total de Finlandia	14.275.114	4,18	154.684	Marr SpA	1.856.208	0,54
				376.433	Technoprobe SpA	2.804.426	0,82
					Total de Italia	22.610.094	6,62
FRANCIA				JERSEY - ISLAS DEL CANAL			
105.569	Elis SA	1.758.780	0,52	819.000	JTC plc	6.892.375	2,02
42.199	Gaztransport Et Technigaz SA	4.916.184	1,44				
233.205	Lectra	6.005.028	1,76		Total de Jersey - Islas del Canal	6.892.375	2,02
11.794	Remy Cointreau	1.363.976	0,40				
229.209	Verallia SA	8.544.911	2,50				
6.777	Virbac SA	1.734.912	0,51				
	Total de Francia	24.323.791	7,13				
ALEMANIA				PAÍSES BAJOS			
158.020	CompuGroup Medical SE & Company KGaA	5.859.382	1,72	59.918	BE Semiconductor Industries	5.572.374	1,63
147.611	CTS Eventim AG	7.948.853	2,33	26.173	IMCD NV	3.140.760	0,92
49.331	Gerresheimer AG	4.905.968	1,44				
73.336	Nemetschek SE	4.244.688	1,24		Total de Países Bajos	8.713.134	2,55
79.209	Schott Pharma AG & Company KGaA	2.506.173	0,73				
105.090	Stabilus SE	5.564.516	1,64				
	Total de Alemania	31.029.580	9,10				
ISLANDIA				ESPAÑA			
1.324.822	Marel HF	3.630.012	1,06	439.925	Fluidra SA	8.521.347	2,50
	Total de Islandia	3.630.012	1,06	47.444	Viscofan SA	2.742.263	0,80
IRLANDA				SUECIA			
1.081.515	AIB Group plc	4.607.254	1,35	347.302	Avanza Bank Holding AB	5.718.657	1,68
628.429	Dalata Hotel Group Limited	2.523.142	0,74	522.127	Elekta AB - B	3.378.101	0,99
768.722	Irish Continental Group plc	3.436.187	1,01	332.176	Engcon AB	2.147.118	0,63
	Total de Irlanda	10.566.583	3,10	776.700	Fortnox AB	3.943.419	1,16
				287.496	Hexpol AB	2.428.183	0,71
				1.609.262	Karnov Group AB	6.757.416	1,98
				127.232	MIPS AB	4.101.501	1,20
				810.989	Munters Group AB	9.905.994	2,90
				227.501	Nordnet AB	2.855.994	0,84
				130.795	Surgical Science Sweden AB	1.709.058	0,50
				189.050	Thule Group AB	4.715.351	1,38
					Total de Suecia	47.660.792	13,97
				SUIZA			
				17.091	Belimo Holding AG	7.690.155	2,25

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities

Estado de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Renta variable (continuación)				Derechos					
SUIZA (continuación)				REINO UNIDO					
3.698	Burckhardt Compression Holding AG	1.907.141	0,56	178.056	Synthomer plc Right	61.580	0,02		
3.827	Inficon Holding AG	4.417.542	1,29	Total de Reino Unido			61.580	0,02	
2.634	LEM Holding SA	5.561.469	1,64	Total de derechos			61.580	0,02	
385.442	SIG Group AG	9.009.814	2,64	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				339.491.342	99,45
11.261	Tecan Group AG - Reg	3.594.983	1,05	Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario					
15.722	Vat Group AG	5.340.526	1,56	Renta variable					
90.563	VZ Holding AG	8.929.653	2,61	DINAMARCA					
Total de Suiza			46.451.283	13,60	49.761	Ow Bunker A/S**	0	0,00	
REINO UNIDO				Total de Dinamarca				0	0,00
615.287	Allfunds Group plc	3.224.104	0,94	Total de renta variable				0	0,00
1.700.130	Ascential plc	4.096.289	1,20	Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario				0	0,00
410.348	Auction Technology Group plc	3.089.069	0,90	Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios					
533.098	Big Yellow Group plc	5.767.711	1,69	Fondos					
401.324	Cvs Group plc	7.545.903	2,21	IRLANDA					
1.400.807	Dr. Martens plc	2.281.826	0,67	10.634	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	1.068.867	0,31		
161.985	FD Technologies PLC	2.733.871	0,80	Total de Irlanda			1.068.867	0,31	
205.018	Future plc	2.101.144	0,62	Total de fondos				1.068.867	0,31
29.286	Games Workshop Group plc	3.568.594	1,05	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios				1.068.867	0,31
235.082	Genus plc	5.680.320	1,66	Valor total de las inversiones				340.560.209	99,76
3.203.533	GlobalData plc	5.613.516	1,64	(Coste total: 320.658.051 EUR)					
974.869	Howden Joinery Group plc	8.276.033	2,42	<i>* Diferencias menores debido al redondeo.</i>					
1.002.559	Ibstock plc	1.646.975	0,48	<i>** Título a su valor razonable.</i>					
135.064	Intermediate Capital Group plc	2.153.396	0,63						
5.317.284	Johnson Service Group plc	8.275.339	2,42						
107.722	Keywords Studios plc	1.921.131	0,56						
897.644	Moonpig Group plc	1.688.832	0,49						
57.911	Renishaw plc	2.351.324	0,69						
750.274	Rightmove plc	4.862.649	1,43						
1.631.475	Rotork plc	5.879.380	1,72						
289.350	St James's Place plc	2.775.961	0,81						
27	Synthomer plc	72	0,00						
597.878	Victoria plc	3.584.083	1,05						
892.002	Volution Group plc	3.720.459	1,09						
676.713	Watches of Switzerland Group plc	4.173.693	1,22						
263.257	YouGov plc	2.276.163	0,67						
Total de Reino Unido			99.287.837	29,06					
Total de renta variable			339.429.762	99,43					

Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2023

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
BÉLGICA				IRLANDA			
321.668	Azelis Group NV	6.018.408	0,95	2.069.705	AIB Group plc	8.816.943	1,39
480	Lotus Bakeries NV	3.691.200	0,58	1.708.301	Dalata Hotel Group Limited	6.858.829	1,08
91.398	Melexis NV	7.467.217	1,18	1.424.908	Irish Continental Group plc	6.369.339	1,01
	Total de Bélgica	17.176.825	2,71		Total de Irlanda	22.045.111	3,48
DINAMARCA				ITALIA			
370.865	Tryg A/S	6.433.082	1,02	133.408	Carel Industries SpA	3.028.362	0,48
	Total de Dinamarca	6.433.082	1,02	37.243	Diasorin SpA	3.218.540	0,51
				1.019.423	Finecobank Banca Fineco SpA	11.738.656	1,85
				1.133.624	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	12.770.274	2,01
				236.006	Interpump Group SpA	10.263.900	1,63
				306.945	Marr SpA	3.683.340	0,58
				1.131.414	Nexi SpA	6.548.624	1,03
				740.761	Technoprobe SpA	5.518.669	0,87
	Total de Finlandia	23.290.286	3,67		Total de Italia	56.770.365	8,96
FRANCIA				JERSEY - ISLAS DEL CANAL			
307.744	Bureau Veritas SA	7.235.061	1,14	675.281	JTC plc	5.682.894	0,90
113.107	Edenred SE	6.704.983	1,06		Total de Jersey - Islas del Canal	5.682.894	0,90
611.557	Elis SA	10.188.541	1,62				
78.602	Gaztransport Et Technigaz SA	9.157.133	1,44				
44.124	Remy Cointreau	5.102.941	0,81				
54.235	SEB SA	4.807.933	0,76				
437.911	Verallia SA	16.325.322	2,58				
12.900	Virbac SA	3.302.400	0,52				
	Total de Francia	62.824.314	9,93				
ALEMANIA				LUXEMBURGO			
34.431	Carl Zeiss Meditec AG	2.851.575	0,45	191.131	Eurofins Scientific SE	10.225.509	1,61
288.960	CompuGroup Medical SE & Company KGaA	10.714.637	1,69		Total de Luxemburgo	10.225.509	1,61
271.864	CTS Eventim AG	14.639.877	2,32				
90.489	Gerresheimer AG	8.999.131	1,42				
96.790	Nemetschek SE	5.602.205	0,88				
190.416	Puma SE	11.196.461	1,77				
146.730	Schott Pharma AG & Company KGaA	4.642.537	0,73				
164.343	Stabilus SE	8.701.962	1,37				
276.877	TeamViewer SE	4.418.957	0,70				
	Total de Alemania	71.767.342	11,33				
ISLANDIA				PAÍSES BAJOS			
2.506.714	Marel HF	6.868.396	1,08	33.090	ASM International NV	13.153.275	2,07
	Total de Islandia	6.868.396	1,08	113.455	BE Semiconductor Industries	10.551.315	1,67
				514.048	Davide Campari-Milano NV	5.739.346	0,90
				43.304	IMCD NV	5.196.480	0,82
					Total de Países Bajos	34.640.416	5,46
				ESPAÑA			
				842.430	Fluidra SA	16.317.869	2,58
				91.393	Viscofan SA	5.282.515	0,83
					Total de España	21.600.384	3,41
				SUECIA			
				648.107	Avanza Bank Holding AB	10.671.697	1,69
				1.098.143	Elekta AB - B	7.104.858	1,12
				1.814.744	Fortnox AB	9.213.720	1,46
				592.500	Hexpol AB	5.004.238	0,79
				101.132	MIPS AB	3.260.131	0,51

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies

Estado de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)				Derechos			
SUECIA (continuación)				REINO UNIDO			
134.170	Munters Group AB	1.638.847	0,26	247.164	Synthomer plc Right	85.481	0,01
435.249	Nordnet AB	5.464.013	0,86				
366.590	Thule Group AB	9.143.615	1,44		Total de Reino Unido	85.481	0,01
	Total de Suecia	51.501.119	8,13		Total de derechos	85.481	0,01
SUIZA				Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa			
30.390	Belimo Holding AG	13.674.086	2,15			626.523.895	98,89
6.906	Burckhardt Compression Holding AG	3.561.578	0,56	Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
7.553	Inficon Holding AG	8.718.498	1,38	Fondos			
728.427	SIG Group AG	17.027.184	2,69	IRLANDA			
21.868	Tecan Group AG - Reg	6.981.181	1,10	3.809	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	382.803	0,06
34.899	Vat Group AG	11.854.664	1,88		Total de Irlanda	382.803	0,06
	Total de Suiza	61.817.191	9,76		Total de fondos	382.803	0,06
REINO UNIDO				Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
1.163.847	Allfunds Group plc	6.098.558	0,96			382.803	0,06
3.530.254	Ascential plc	8.505.785	1,34		Valor total de las inversiones	626.906.698	98,95
854.007	Auction Technology Group plc	6.428.901	1,01		(Coste total: 655.541.178 EUR)		
983.115	Big Yellow Group plc	10.636.549	1,68	<i>* Diferencias menores debido al redondeo.</i>			
763.263	Cvs Group plc	14.351.269	2,26				
3.338.856	Dr. Martens plc	5.438.786	0,86				
1.466.515	Elementis plc	2.099.763	0,33				
300.975	FD Technologies PLC	5.079.648	0,80				
382.907	Future plc	3.924.255	0,62				
54.389	Games Workshop Group plc	6.627.477	1,05				
449.677	Genus plc	10.865.610	1,71				
4.016.800	GlobalData plc	7.038.595	1,11				
1.836.067	Howden Joinery Group plc	15.587.069	2,46				
1.953.010	Ibstock plc	3.208.348	0,51				
260.802	Intermediate Capital Group plc	4.158.103	0,66				
209.824	Keywords Studios plc	3.742.033	0,59				
1.774.903	Moonpig Group plc	3.339.311	0,53				
205.315	Renishaw plc	8.336.278	1,32				
766.582	Rentokil Initial plc	5.392.535	0,85				
1.393.357	Rightmove plc	9.030.576	1,43				
3.060.261	Rotork plc	11.028.326	1,74				
967.115	St James's Place plc	9.278.291	1,46				
45	Synthomer plc	120	0,00				
913.925	Victoria plc	5.478.681	0,86				
1.316.609	Watches of Switzerland Group plc	8.120.313	1,29				
	Total de Reino Unido	173.795.180	27,43				
	Total de renta variable	626.438.414	98,88				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Select

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2023

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Renta variable				Renta variable (continuación)				
DINAMARCA				NORUEGA				
163.643	DSV A/S	28.945.365	1,94	2.151.155	DNB Bank ASA	41.166.943	2,76	
857.756	Novo Nordisk A/S	74.066.018	4,96		Total de Noruega	41.166.943	2,76	
1.693.718	Tryg A/S	29.379.496	1,97					
	Total de Dinamarca	132.390.879	8,87					
FRANCIA				ESPAÑA				
210.052	Air Liquide SA	33.574.712	2,25	725.818	Amadeus IT Group SA - A	41.574.855	2,79	
622.180	Compagnie de Saint-Gobain	35.389.598	2,37	1.704.357	Inditex SA	60.146.758	4,03	
204.189	Dassault Systemes SE	7.206.851	0,48		Total de España	101.721.613	6,82	
28.170	Hermes International	48.728.466	3,27					
363.057	Legrand SA	31.694.876	2,12		SUECIA			
99.821	L'Oreal SA	39.249.617	2,63	3.530.396	Atlas Copco AB	45.194.492	3,03	
94.404	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	67.631.026	4,53	1.786.145	Sandvik AB	31.305.022	2,10	
201.998	Pernod-Ricard SA	31.885.384	2,13		Total de Suecia	76.499.514	5,13	
438.266	Schneider Electric SE	68.798.997	4,61					
	Total de Francia	364.159.527	24,39		SUIZA			
ALEMANIA					188.305	DSM-Firmenich AG	15.088.880	1,01
630.186	Brenntag SE	46.306.067	3,10	83.720	Lonza Group AG - Reg	36.788.427	2,47	
242.646	Hannover Rueckversicherung AG - Reg	50.446.103	3,38	701.757	Nestle SA - Reg	75.164.604	5,04	
164.787	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG - Reg	60.822.882	4,08	17.091	Partners Group Holding AG - Reg	18.254.853	1,22	
457.154	SAP SE	56.147.654	3,76	105.370	Roche Holding AG	27.246.981	1,83	
339.077	Siemens Healthineers AG	16.275.696	1,09	113.054	Sika AG	27.208.750	1,82	
540.866	Zalando SE	11.428.499	0,77	75.253	Vat Group AG	25.562.309	1,72	
	Total de Alemania	241.426.901	16,18		Total de Suiza	225.314.804	15,11	
ITALIA					REINO UNIDO			
2.669.748	Fincobank Banca Fineco SpA	30.742.148	2,06	2.596.632	Allfunds Group plc	13.606.352	0,91	
1.733.670	Nexi SpA	10.034.482	0,67		Total de Reino Unido	13.606.352	0,91	
	Total de Italia	40.776.630	2,73		Total de renta variable	1.448.657.810	97,08	
PAÍSES BAJOS					Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	1.448.657.810	97,08	
100.820	ASM International NV	40.075.950	2,69		Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
144.186	ASML Holding NV	80.614.393	5,40		Fondos			
2.014.418	Davide Campari-Milano NV	22.490.977	1,51		IRLANDA			
313.505	IMCD NV	37.620.600	2,52	309.287	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	31.086.558	2,08	
751.317	STMicroelectronics NV	30.792.727	2,06					
	Total de Países Bajos	211.594.647	14,18					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Select

Estado de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios (continuación)			
Fondos (continuación)			
IRLANDA (continuación)			
10.204	ILF EUR Liquidity Fund	1.008.289	0,07
	Total de Irlanda	32.094.847	2,15
	Total de fondos	32.094.847	2,15
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	32.094.847	2,15
	Valor total de las inversiones	1.480.752.657	99,23
	(Coste total: 1.260.944.261 EUR)		

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2023

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
BÉLGICA				ISLANDIA			
1.011.652	Azelis Group NV	18.928.009	1,41	5.225.516	Marel HF	14.317.914	1,07
2.543	Lotus Bakeries NV	19.555.670	1,47				
333.963	Melexis NV	27.284.777	2,03		Total de Islandia	14.317.914	1,07
	Total de Bélgica	65.768.456	4,91				
DINAMARCA				IRLANDA			
140.154	Simcorp A/S	13.795.529	1,03	5.496.449	AIB Group plc	23.414.873	1,75
1.458.911	Tryg A/S	25.306.497	1,90	3.260.141	Dalata Hotel Group Limited	13.089.466	0,98
	Total de Dinamarca	39.102.026	2,93	2.735.190	Irish Continental Group plc	12.226.299	0,92
				234.563	Kingspan Group plc	16.644.590	1,25
					Total de Irlanda	65.375.228	4,90
FINLANDIA				ITALIA			
273.262	Cargotec Oyj	10.837.571	0,81	273.295	Carel Industries SpA	6.203.797	0,46
729.618	Huhtamaki Oyj	22.727.601	1,70	76.730	Diasorin SpA	6.631.007	0,50
695.724	Konecranes Oyj	21.887.477	1,64	2.301.428	Fincombank Banca Fineco SpA	26.500.943	1,99
906.735	Metso Oyj	9.025.640	0,68	2.629.360	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	29.619.740	2,22
480.265	Musti Group Oyj	8.644.770	0,65	592.313	Intercos SpA	7.605.299	0,57
477.205	Vaisala Oyj	15.843.206	1,19	488.293	Interpump Group SpA	21.235.863	1,59
	Total de Finlandia	88.966.265	6,67	617.980	Marr SpA	7.415.760	0,56
				1.926.251	Nexi SpA	11.149.141	0,84
				1.516.010	Technoprobe SpA	11.294.275	0,85
					Total de Italia	127.655.825	9,58
FRANCIA				LUXEMBURGO			
1.205.739	Bureau Veritas SA	28.346.923	2,11	176.593	Eurofins Scientific SE	9.447.726	0,71
242.360	Edenred SE	14.367.101	1,07		Total de Luxemburgo	9.447.726	0,71
800.341	Elis SA	13.333.681	1,00				
180.752	Gaztransport Et Technigaz SA	21.057.608	1,58				
148.927	Remy Cointreau	17.223.408	1,29				
198.014	SEB SA	17.553.941	1,32				
934.608	Verallia SA	34.842.186	2,62				
24.364	Virbac SA	6.237.184	0,47				
	Total de Francia	152.962.032	11,46				
ALEMANIA				PAÍSES BAJOS			
70.567	Atoss Software AG	13.831.132	1,04	91.849	ASM International NV	36.509.977	2,73
327.720	Brenntag SE	24.080.866	1,80	269.283	BE Semiconductor Industries	25.043.319	1,88
70.845	Carl Zeiss Meditec AG	5.867.383	0,44	2.558.881	Davide Campari-Milano NV	28.569.906	2,14
571.164	CompuGroup Medical SE & Company KgaA	21.178.761	1,59	206.553	IMCD NV	24.786.360	1,86
488.480	CTS Eventim AG	26.304.648	1,97		Total de Países Bajos	114.909.562	8,61
241.898	Gerresheimer AG	24.056.756	1,80				
410.995	Nemetschek SE	23.788.391	1,79				
299.408	Puma SE	17.605.190	1,32				
22.115	Rational AG	13.269.000	0,99				
309.708	Schott Pharma AG & Company KGaA	9.799.161	0,73				
388.914	Stabilus SE	20.592.996	1,54				
	Total de Alemania	200.374.284	15,01				
				ESPAÑA			
				1.703.848	Fluidra SA	33.003.536	2,47
				187.083	Viscofan SA	10.813.397	0,81
					Total de España	43.816.933	3,28
				SUECIA			
				1.476.996	Avanza Bank Holding AB	24.320.140	1,83
				2.291.568	Elekta AB - B	14.826.177	1,11
				3.346.153	Fortnox AB	16.988.906	1,27
				776.668	Hemnet Group AB	13.024.901	0,98

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies

Estado de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Renta variable (continuación)				Fondos			
SUECIA (continuación)				IRLANDA			
1.449.835	Hexpol AB	12.245.264	0,92	306.143	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	30.770.545	2,31
280.476	MIPS AB	9.041.536	0,68				
259.765	Munters Group AB	3.172.954	0,24		Total de Irlanda	30.770.545	2,31
1.545.926	Nordnet AB	19.407.191	1,45				
904.892	Thule Group AB	22.570.131	1,69		Total de fondos	30.770.545	2,31
145.906	Vitrolife AB	1.864.650	0,14		Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	30.770.545	2,31
	Total de Suecia	137.461.850	10,31		Valor total de las inversiones	1.340.185.338	100,41
SUIZA							
79.420	Belimo Holding AG	35.735.305	2,67				
55.268	Burckhardt Compression Holding AG	28.502.937	2,13				
19.413	Inficon Holding AG	22.408.606	1,68				
11.135	LEM Holding SA	23.510.611	1,76				
1.508.870	SIG Group AG	35.270.257	2,64				
112.193	Sika AG	27.001.532	2,02				
182.575	SKAN Group AG	14.665.649	1,10				
72.835	Tecan Group AG - Reg	23.251.982	1,74				
83.634	Vat Group AG	28.409.209	2,13				
	Total de Suiza	238.756.088	17,87				
REINO UNIDO							
2.003.932	Allfunds Group plc	10.500.604	0,79				
	Total de Reino Unido	10.500.604	0,79				
	Total de renta variable	1.309.414.793	98,10				
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				(Coste total: 1.116.357.392 EUR)			
		1.309.414.793	98,10				
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario							
Renta variable							
DINAMARCA							
280.528	Ow Bunker A/S**	0	0,00				
	Total de Dinamarca	0	0,00				
	Total de renta variable	0	0,00				
Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario							
		0	0,00				

*Diferencias menores debido al redondeo.

**Titulo a su valor razonable.

Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2023

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
AUSTRALIA				INDIA (continuación)			
106.953	ANZ Group Holdings Limited	1.771.245	2,38	415.605	Embassy Office Parks REIT	1.504.467	2,03
63.384	Carsales.com Limited	1.142.970	1,54	111.326	HDFC Bank Limited	2.046.138	2,74
516.769	Deterra Royalties Limited	1.597.574	2,15	96.313	Infosys Limited	1.664.837	2,24
172.445	Dexus	812.461	1,09	320.691	ITC Limited	1.716.167	2,31
11.060	Macquarie Group Limited	1.197.278	1,61	759.996	Power Grid Corp. of India Limited	1.828.086	2,46
23.624	Mineral Resources Limited	1.031.150	1,39		Total de India	10.284.183	13,83
454.585	Santos Limited	2.317.774	3,12				
408.415	Telstra Group Limited	1.014.826	1,36				
225.361	Transurban Group	1.845.735	2,48				
	Total de Australia	12.731.013	17,12				
ISLAS CAIMÁN				INDONESIA			
372.000	China Resources Land Limited	1.481.952	1,99	1.989.200	Bank Negara Indonesia Tbk PT	1.328.840	1,79
82.600	JD.com Inc.	1.213.925	1,63	5.463.878	Bank Rakyat Indonesia	1.847.105	2,48
94.885	NetEase Inc.	1.932.390	2,60	1.967.900	Indofood Cbp Sukses Makmur Tbk PT	1.410.104	1,90
125.400	Shenzhou International Group Holdings Limited	1.200.868	1,61		Total de Indonesia	4.586.049	6,17
	Total de Islas Caimán	5.829.135	7,83				
CHINA				FILIPINAS			
1.112.600	Baoshan Iron & Steel Company Limited - A	929.997	1,25	655.800	BDO Unibank Inc.	1.644.801	2,21
1.120.000	China Construction Bank Corp.	632.087	0,85		Total de Filipinas	1.644.801	2,21
208.442	Inner Mongolia Yili Industrial Group Company Limited - A	759.010	1,02				
166.500	Ping An Insurance Group Company of China Limited	953.483	1,28				
35.400	Wuliangye Yibin Company Limited - A	758.457	1,02				
	Total de China	4.033.034	5,42				
HONG KONG				REPÚBLICA DE COREA (SUR)			
236.600	AIA Group Limited	1.928.911	2,60	101.534	Samsung Electronics Company Limited Pfd	4.100.787	5,51
350.500	Boc Hong Kong Holdings Limited	959.957	1,29	39.213	SK Telecom Company Limited	1.511.098	2,04
271.000	Galaxy Entertainment Group Limited	1.631.501	2,19		Total de República de Corea (Sur)	5.611.885	7,55
43.922	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	1.640.940	2,20				
1.284.000	Lenovo Group Limited	1.323.046	1,78				
268.400	Link Real Estate Investment Trust	1.315.983	1,77				
	Total de Hong Kong	8.800.338	11,83				
INDIA				SINGAPUR			
25.001	Bajaj Auto Limited	1.524.488	2,05	577.400	CapitaLand Ascendas REIT	1.163.345	1,56
				68.200	DBS Group Holdings Limited	1.680.890	2,26
				275.700	Keppel Corp. Limited	1.373.550	1,85
					Total de Singapur	4.217.785	5,67
				TAIWÁN			
				121.737	Chailease Holding Company Limited	682.582	0,92
				205.000	Chroma ATE Inc.	1.752.734	2,35
				133.000	Delta Electronics Inc.	1.336.964	1,80
				179.000	E Ink Holdings Inc.	995.339	1,34
				12.000	eMemory Technology Inc.	749.048	1,01
				368.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	5.962.150	8,01
				219.000	Unimicron Technology Corp.	1.177.056	1,58
				73.000	Yageo Corp.	1.187.232	1,60
					Total de Taiwán	13.843.105	18,61

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income

Estado de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)			
TAILANDIA			
10.633.341	WHA Corp pcl	1.533.123	2,06
	Total de Tailandia	1.533.123	2,06
	Total de renta variable	73.114.451	98,30
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	73.114.451	98,30
	Valor total de las inversiones	73.114.451	98,30

(Coste total: 75.331.278 USD)

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Global Technology

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2023

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
ISLAS CAIMÁN				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
246.546	Smart Global Holdings Inc.	6.003.395	0,82	78.944	Fidelity National Information Services Inc.	4.363.235	0,60
	Total de Islas Caimán	6.003.395	0,82	41.943	Fiserv Inc.	4.737.881	0,65
ALEMANIA				179.292	Fortinet Inc.	10.520.855	1,44
196.518	TeamViewer SE	3.320.692	0,45	551.087	Gen Digital Inc.	9.743.218	1,33
	Total de Alemania	3.320.692	0,45	262.792	GoDaddy Inc.	19.572.749	2,68
ISRAEL				129.618	HireRight Holdings Corp.	1.232.667	0,17
19.789	Cyberark Software Limited	3.240.845	0,44	58.072	Kulicke & Soffa Industries Inc.	2.824.041	0,39
56.882	Tower Semiconductor Limited	1.397.022	0,19	75.517	Lam Research Corp.	47.331.790	6,49
	Total de Israel	4.637.867	0,63	111.383	Lumentum Holdings Lite US	5.032.284	0,69
JAPÓN				314.984	Marvell Technology Inc.	17.050.084	2,33
1.270.700	Renesas Electronics Corp.	19.461.785	2,66	87.966	Match Group Inc.	3.446.068	0,47
163.300	SUMCO Corp.	2.132.831	0,29	23.535	Meta Platforms Inc.	7.065.442	0,97
	Total de Japón	21.594.616	2,95	152.982	Microchip Technology Inc.	11.940.245	1,63
PAÍSES BAJOS				113.425	Microsoft Corp.	35.813.944	4,91
56.335	NXP Semiconductor NV	11.262.493	1,54	179.366	NetApp Inc.	13.610.292	1,86
	Total de Países Bajos	11.262.493	1,54	23.636	Nvidia Corp.	10.281.424	1,41
ESTADOS UNIDOS				99.024	ON Semiconductor Corp.	9.204.281	1,26
120.692	Activision Blizzard Inc.	11.300.392	1,55	127.640	Oracle Corp.	13.519.629	1,85
512.123	Adeia Inc.	5.469.474	0,75	71.615	Palo Alto Networks Inc.	16.789.421	2,30
106.551	Advanced Energy Industries Inc.	10.987.539	1,50	115.145	Pinterest Inc.	3.112.369	0,43
255.362	Alphabet Inc. - A	33.416.671	4,57	68.598	Qorvo Inc.	6.549.051	0,90
95.020	Alphabet Inc. - C	12.528.387	1,72	51.978	Rambus Inc.	2.899.853	0,40
94.734	Analog Devices Inc.	16.586.976	2,27	126.568	Ringcentral Inc. - A	3.750.210	0,51
214.073	Apple Inc.	36.651.439	5,02	12.341	Salesforce.com Inc.	2.502.508	0,34
189.930	Applied Materials Inc.	26.295.809	3,60	135.720	Semtech Corp.	3.494.790	0,48
60.360	AppLovin Corp.	2.411.986	0,33	687	Skyworks Solutions Inc.	67.731	0,01
47.753	Arista Networks Inc.	8.783.209	1,20	63.776	Splunk Inc.	9.327.240	1,28
1.117.817	Bloom Energy Corp.	14.822.253	2,03	173.592	Synaptics Inc.	15.526.068	2,13
41.613	Broadcom Inc.	34.562.926	4,73	54.951	Synopsys Inc.	25.220.860	3,45
139.586	Cerence Inc.	2.843.367	0,39	74.274	Tenable Holdings Inc.	3.327.475	0,46
96.461	Comcast Corp.	4.277.081	0,59	225.091	Teradyne Inc.	22.612.642	3,10
163.603	Dell Technologies Inc. - C	11.272.247	1,54	31.059	T-Mobile USA Inc.	4.349.813	0,60
776.453	Dropbox Inc. - A	21.142.815	2,89	77.440	Visa Inc. - A	17.811.974	2,44
127.974	Dxc Technology Company	2.665.698	0,36	43.305	VMware Inc. - A	7.209.416	0,99
319.871	Ebay Inc.	14.103.112	1,93	171.768	Western Digital Corp.	7.837.774	1,07
379.313	Eiger Biopharmaceuticals Inc.	115.690	0,02		Total de Estados Unidos	660.722.605	90,49
67.061	F5 Inc.	10.806.210	1,48		Total de renta variable	707.541.668	96,88
					Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	707.541.668	96,88
					Valor total de las inversiones	707.541.668	96,88
					(Coste total: 556.568.041 USD)		

*Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - UK Equity Income

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2023

Cantidad	Inversión	Valor de mercado GBP	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado GBP	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
GUERNSEY - ISLAS DEL CANAL				REINO UNIDO (continuación)			
3.410.408	Sherborne Investors Guernsey	1.952.459	0,86	436.500	Travis Perkins plc	3.685.806	1,62
	Total de Guernsey - Islas del Canal	1.952.459	0,86	39.376	Unbound Group plc**	0	0,00
				168.531	Unilever plc	6.845.729	3,01
				81.890	Victrex plc	1.150.555	0,51
				95.397	Whitbread plc	3.304.552	1,46
				1.051.560	Wincanton plc	2.881.274	1,27
					Total de Reino Unido	221.983.622	97,78
					Total de renta variable	223.936.081	98,64
					Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	223.936.081	98,64
					Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		
					Fondos		
					IRLANDA		
				3.677.462	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	3.677.462	1,62
					Total de Irlanda	3.677.462	1,62
					Total de fondos	3.677.462	1,62
					Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	3.677.462	1,62
					Valor total de las inversiones	227.613.543	100,26
					(Coste total: 223.880.777 GBP)		
					<i>* Diferencias menores debido al redondeo.</i>		
					<i>** Título a su valor razonable.</i>		
288.063	3i Group plc	5.971.546	2,63				
94.945	Astrazeneca plc	10.540.794	4,64				
163.743	BAE Systems plc	1.633.828	0,72				
295.020	Britvic plc	2.572.574	1,13				
4.035.977	BT Group plc	4.709.985	2,07				
4.577.454	Centrica plc	7.069.878	3,11				
804.336	Chesnara plc	2.211.924	0,97				
259.863	Compass Group	5.197.260	2,29				
2.492.276	Direct Line Insurance Group plc	4.291.699	1,89				
990.174	Dowlais Group plc	1.063.447	0,47				
1.194.251	DS Smith plc	3.428.695	1,51				
909.154	Elementis plc	1.129.169	0,50				
45.725	Ferguson plc	6.202.596	2,74				
2.530.234	Firstgroup plc	3.818.123	1,69				
635.087	GSK plc	9.475.498	4,17				
852.463	Haleon plc	2.905.620	1,28				
3.865.710	Hays plc	4.221.355	1,86				
195.709	Hikma Pharmaceuticals plc	4.086.404	1,80				
303.824	IMI plc	4.763.960	2,10				
803.221	Imperial Brands plc	13.389.694	5,90				
822.084	International Distributions Services plc	2.143.995	0,94				
5.567.670	ITV plc	3.931.889	1,73				
208.827	Johnson Matthey plc	3.399.703	1,49				
885.544	Land Securities Group plc	5.222.939	2,30				
2.763.435	Legal & General Group plc	6.148.643	2,71				
2.751.645	Marks & Spencer Group plc	6.510.392	2,87				
912.405	Morgan Advanced Materials plc	2.235.392	0,98				
180.202	Morgan Sindall plc	3.703.151	1,63				
170.641	Oxford Instruments plc	3.719.974	1,64				
1.118.539	Pearson plc	9.713.392	4,28				
1.200.736	Phoenix Group Holdings plc	5.789.949	2,55				
1.320.130	Rank Group plc	1.104.949	0,49				
259.724	RELX plc	7.207.341	3,17				
1.887.757	Rentokil Initial plc	11.519.093	5,08				
1.464.379	RS Group plc	10.769.043	4,74				
370.180	Smith & Nephew plc	3.786.941	1,67				
323.482	Smiths Group plc	5.238.792	2,31				
223.744	SSE plc	3.602.278	1,59				
660.410	Tate & Lyle plc	4.527.111	1,99				
1.951.813	Tesco plc	5.156.690	2,28				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2023

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos				Bonos (continuación)					
AUSTRALIA				ALEMANIA (continuación)					
EUR	1.448.000	APT Pipelines Limited 1.25% 15/03/2033	1.051.359	0,47	EUR	1.400.000	Amprion GmbH 0.63% 23/09/2033	995.401	0,45
EUR	1.098.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031	836.109	0,38	EUR	400.000	Bayer AG FRN 25/09/2083	396.052	0,18
EUR	900.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031	685.335	0,31	EUR	1.547.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.50% 11/02/2027	1.413.073	0,64
EUR	1.920.000	AusNet Services Holdings Pty Limited 0.63% 25/08/2030	1.505.532	0,68	EUR	1.000.000	Commerzbank AG FRN 05/10/2033	987.397	0,44
EUR	1.207.000	NBN Company Limited 4.38% 15/03/2033	1.189.471	0,54	EUR	2.000.000	Deutsche Bank AG FRN 19/11/2030	1.587.072	0,71
		Total de Australia	5.267.806	2,38	USD	1.222.000	Deutsche Bank AG FRN 10/02/2034	1.044.265	0,47
BÉLGICA				Bonos (continuación)					
EUR	6.700.000	Belfius Bank SA - Perp FRN	6.700.770	3,03	EUR	1.400.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 16/05/2027	1.277.042	0,58
EUR	2.600.000	Kbc Group NV - Perp FRN	2.236.691	1,01	EUR	800.000	Deutsche Lufthansa AG 3.75% 11/02/2028	740.654	0,33
		Total de Bélgica	8.937.461	4,04	EUR	1.081.000	Gruenenthal GmbH 3.63% 15/11/2026	1.027.532	0,46
ISLAS CAIMÁN				Bonos (continuación)					
GBP	1.175.000	Thames Water Utilities plc 2.88% 03/05/2027	1.020.000	0,46	EUR	1.200.000	Hamburg Commercial Bank AG 4.88% 30/03/2027	1.187.970	0,53
		Total de Islas Caimán	1.020.000	0,46	EUR	545.866	IHO Verwaltungs GmbH 8.75% 15/05/2028	563.953	0,25
FRANCIA				Bonos (continuación)					
EUR	400.000	Altice France SA 2.50% 15/01/2025	380.013	0,17	EUR	558.000	Ineos Styrolution Group GmbH 2.25% 16/01/2027	486.131	0,22
EUR	1.300.000	BNP Paribas SA FRN 26/09/2032	1.279.961	0,58	EUR	1.900.000	Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	1.463.446	0,66
USD	3.500.000	BNP Paribas SA - Perp FRN	2.697.054	1,21	EUR	858.000	PCF GmbH 4.75% 15/04/2026	672.613	0,30
EUR	1.600.000	BPCE SA FRN 13/10/2046	1.172.430	0,53	EUR	1.540.000	Peach Property Finance GmbH 4.38% 15/11/2025	1.248.500	0,56
EUR	1.165.000	Elior Group SA 3.75% 15/07/2026	921.414	0,41	EUR	1.300.000	Schaeffler AG 3.38% 12/10/2028	1.177.044	0,53
EUR	1.454.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	1.418.175	0,64	EUR	1.500.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH 2.00% 15/07/2025	1.447.651	0,65
EUR	3.080.000	Iliad Holding SASU 5.13% 15/10/2026	2.935.029	1,31	EUR	1.000.000	Vier Gas Transport GmbH 4.63% 26/09/2032	1.011.244	0,46
EUR	1.686.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	1.658.937	0,75			Total de Alemania	22.127.681	9,96
EUR	300.000	Praemia Healthcare SACA 5.50% 19/09/2028	298.898	0,13	GIBRALTAR				
EUR	546.000	RCI Banque SA 4.88% 02/10/2029	542.147	0,24	EUR	1.448.000	888 Acquisitions Limited 7.56% 15/07/2027	1.341.696	0,60
EUR	539.000	Rexel SA 5.25% 15/09/2030	533.644	0,24			Total de Gibraltar	1.341.696	0,60
GBP	600.000	Suez SACA 6.63% 05/10/2043	691.714	0,31	GRECIA				
		Total de Francia	14.529.416	6,52	EUR	1.370.000	Eurobank SA FRN 26/01/2029	1.429.014	0,64
ALEMANIA				Bonos (continuación)					
EUR	4.200.000	Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	3.400.641	1,54	EUR	696.000	National Bank of Greece SA FRN 03/01/2034	702.960	0,32
							Total de Grecia	2.131.974	0,96

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
INDIA				LUXEMBURGO (continuación)					
USD	530.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029	400.990	0,18	EUR	194.000	Cirsa Finance International Sarl 10.38% 30/11/2027	209.184	0,09
		Total de India	400.990	0,18	EUR	480.000	Eurofins Scientific SE - Perp FRN	442.958	0,20
					EUR	574.000	Eurofins Scientific SE - Perp FRN	570.472	0,26
					EUR	437.000	Garfunkelux Holdingco 3 SA 6.75% 01/11/2025	338.894	0,15
IRLANDA				PAÍSES BAJOS					
EUR	1.275.000	Aib Group plc FRN 30/05/2031	1.178.968	0,53	GBP	931.000	Garfunkelux Holdingco 3 SA 7.75% 01/11/2025	818.370	0,37
EUR	1.997.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	1.775.614	0,80	EUR	2.000.000	Grand City Properties SA - Perp FRN	958.750	0,43
EUR	838.000	Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	790.035	0,36	EUR	1.883.000	InPost SA 2.25% 15/07/2027	1.641.478	0,74
EUR	1.477.000	Permanent TSB Group Holdings plc FRN 25/04/2028	1.495.447	0,67	EUR	819.000	Loarre Investments Sarl 6.50% 15/05/2029	767.005	0,35
		Total de Irlanda	5.240.064	2,36	EUR	840.000	Loarre Investments Sarl FRN 15/05/2029	845.075	0,38
					EUR	750.000	Matterhorn Telecom SA 2.63% 15/09/2024	743.946	0,34
ITALIA				Total de Luxemburgo					
EUR	609.000	Autostrade per l'Italia SpA 4.75% 24/01/2031	592.341	0,27	EUR	1.155.000	P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	918.957	0,41
EUR	1.344.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1.88% 09/01/2026	1.206.129	0,54	EUR	1.473.000	Sani/Ikos Financial Holdings 1 Sarl 5.63% 15/12/2026	1.364.850	0,61
EUR	1.425.000	FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA 5.63% 01/08/2027	1.319.118	0,59	EUR	940.000	SELP Finance Sarl 3.75% 10/08/2027	897.097	0,40
EUR	392.000	Lottomatica SpA 7.13% 01/06/2028	401.302	0,18			Total de Luxemburgo	17.312.744	7,78
EUR	1.096.000	Lottomatica SpA 9.75% 30/09/2027	1.183.643	0,53					
EUR	711.000	Telecom Italia SpA 4.00% 11/04/2024	706.938	0,32					
EUR	1.790.000	Telecom Italia SpA 6.88% 15/02/2028	1.801.001	0,81					
		Total de Italia	7.210.472	3,24					
LUXEMBURGO									
EUR	419.000	Altice Finco SA 4.75% 15/01/2028	338.343	0,15	EUR	702.000	ASR Nederland NV FRN 07/12/2043	722.184	0,33
EUR	348.000	Altice France Holding SA 4.00% 15/02/2028	165.087	0,07	EUR	1.000.000	Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV 3.75% 15/01/2025	987.180	0,44
EUR	456.000	Altice France Holding SA 8.00% 15/05/2027	263.836	0,12	EUR	1.450.000	Constellium NV 4.25% 15/02/2026	1.419.723	0,64
EUR	3.600.000	Aroundtown SA 1.45% 09/07/2028	2.619.759	1,18	EUR	2.200.000	Cooperatieve Rabobank UA - Perp FRN	1.660.987	0,75
GBP	1.855.000	Aroundtown SA 3.00% 16/10/2029	1.464.199	0,66	EUR	1.662.000	Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	1.616.002	0,72
EUR	1.575.000	Canpack SA 2.38% 01/11/2027	1.360.498	0,61	GBP	618.000	E.ON International Finance BV 6.25% 03/06/2030	728.332	0,33
EUR	580.000	Cirsa Finance International Sarl 7.88% 31/07/2028	583.986	0,26	EUR	1.038.000	House of HR Group BV 9.00% 03/11/2029	1.016.114	0,46
					USD	4.600.000	ING Groep NV - Perp FRN	3.156.048	1,42
					EUR	1.300.000	OI European Group BV 2.88% 15/02/2025	1.267.472	0,57
					EUR	1.391.000	Sagax Euro MTN BV 0.75% 26/01/2028	1.113.122	0,50
					EUR	2.620.000	Stedin Holding NV - Perp FRN	2.273.668	1,01
					EUR	2.240.000	Stichting AK Rabobank Certificaten - Perp 6.50%	2.063.102	0,93

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)			
PAÍSES BAJOS (continuación)				REINO UNIDO (continuación)			
EUR	913.527 Summer BidCo BV 9.00% 15/11/2025	889.674	0,40	GBP	171.000 Bellis Acquisition Company plc 4.50% 16/02/2026	175.494	0,08
EUR	1.400.000 Telefonica Europe BV - Perp FRN	1.196.294	0,54	GBP	858.000 Boparan Finance plc 7.63% 30/11/2025	677.321	0,31
EUR	600.000 Telefonica Europe BV - Perp FRN	588.662	0,27	EUR	1.038.000 British American Tobacco plc - Perp FRN	891.528	0,40
EUR	300.000 Telefonica Europe BV - Perp FRN	296.628	0,13	GBP	394.500 Broadgate Financing plc 5.10% 05/04/2033	403.649	0,18
EUR	300.000 Telefonica Europe BV - Perp FRN	308.616	0,14	GBP	1.124.000 Co-Operative Bank Finance plc FRN 06/04/2027	1.186.707	0,53
EUR	1.800.000 Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	1.354.067	0,61	GBP	1.100.000 Deuce Finco plc 5.50% 15/06/2027	1.116.955	0,50
GBP	1.200.000 Volkswagen International Finance NV 4.13% 17/11/2031	1.188.357	0,54	EUR	556.000 DS Smith plc 4.50% 27/07/2030	544.713	0,25
EUR	300.000 ZF Europe Finance BV 6.13% 13/03/2029	300.487	0,14	EUR	911.000 EC Finance plc 3.00% 15/10/2026	849.942	0,38
	Total de Países Bajos	24.146.719	10,87	EUR	4.630.000 HBOS plc FRN 18/03/2030	4.535.639	2,04
ESPAÑA				EUR	3.600.000 HSBC Holdings plc - Perp FRN	3.008.363	1,35
EUR	2.600.000 Cellnex Telecom SA 1.88% 26/06/2029	2.210.649	1,00	EUR	1.004.000 Ineos Finance plc 3.38% 31/03/2026	947.511	0,43
EUR	1.903.000 Grifols SA 3.20% 01/05/2025	1.836.342	0,83	EUR	787.000 Ineos Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	718.219	0,32
EUR	2.239.000 Lorca Telecom Bondco SA 4.00% 18/09/2027	2.083.949	0,94	GBP	308.000 Inspired Entertainment Financing plc 7.88% 01/06/2026	338.956	0,15
	Total de España	6.130.940	2,77	EUR	1.034.000 International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	989.652	0,45
SUECIA				EUR	532.000 Jaguar Land Rover Automotive plc 5.88% 15/11/2024	533.261	0,24
EUR	1.226.000 Intrum AB 4.88% 15/08/2025	1.116.812	0,50	GBP	1.543.000 Jerrold Finco plc 4.88% 15/01/2026	1.671.138	0,76
EUR	1.736.000 Sagax AB 1.13% 30/01/2027	1.507.199	0,68	GBP	1.154.453 Mitchells & Butlers Finance plc 5.57% 15/12/2030	1.268.111	0,57
EUR	525.000 Verisure Holding AB 3.25% 15/02/2027	472.951	0,21	GBP	16.808 Mitchells & Butlers Finance plc 5.97% 15/12/2023	19.171	0,01
EUR	380.000 Verisure Holding AB 7.13% 01/02/2028	384.645	0,17	GBP	1.349.261 Mitchells & Butlers Finance plc 6.01% 15/12/2028	1.439.817	0,65
EUR	642.000 Verisure Holding AB 9.25% 15/10/2027	682.769	0,31	EUR	1.017.000 National Grid Electricity Distribution East Midlands plc 3.95% 20/09/2032	968.951	0,44
	Total de Suecia	4.164.376	1,87	EUR	1.240.000 Pinnacle Bidco plc 5.50% 15/02/2025	1.255.558	0,57
SUIZA				EUR	653.000 Pinnacle Bidco plc 8.25% 11/10/2028	651.883	0,29
USD	2.576.000 Credit Suisse AG 5.00% 09/07/2027	2.341.732	1,05	GBP	304.000 Pinnacle Bidco plc 10.00% 11/10/2028	350.347	0,16
	Total de Suiza	2.341.732	1,05	GBP	1.250.000 Rolls-Royce plc 5.75% 15/10/2027	1.371.991	0,62
REINO UNIDO				GBP	1.295.000 Santander UK plc - Perp 10.06%	1.976.587	0,89
USD	1.400.000 Barclays plc FRN 24/11/2032	996.532	0,45	EUR	3.120.000 Synthomer plc 3.88% 01/07/2025	2.985.982	1,35
GBP	950.000 Bellis Acquisition Company 3.25% 16/02/2026	954.662	0,43	GBP	1.769.000 Telereal Securitisation plc FRN 10/12/2033	1.827.862	0,82

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)						
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)						
REINO UNIDO (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)						
GBP	3.096.417	Tesco Property Finance 3 plc 5.74% 13/04/2040	3.320.053	1,49	USD	2.385.000	Warnermedia Holdings Inc. 5.14% 15/03/2052	1.676.464	0,75	
GBP	740.000	Thames Water Kemble Finance plc 4.63% 19/05/2026	528.801	0,24	Total de Estados Unidos			16.802.190	7,55	
EUR	1.390.000	Victoria plc 3.63% 26/08/2026	1.101.645	0,50	Total de bonos			187.617.527	84,44	
EUR	600.000	Virgin Money UK plc FRN 29/10/2028	578.536	0,26	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				187.617.527	84,44
GBP	413.000	Virgin Money UK plc FRN 23/08/2029	483.715	0,22	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente					
GBP	2.567.000	Vmed O2 UK Financing 4.00% 31/01/2029	2.426.424	1,09	Bonos					
USD	2.586.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	2.414.584	1,08	AUSTRALIA					
EUR	1.809.000	Vodafone Group plc FRN 30/08/2084	1.825.885	0,82	USD	885.000	NBN Company Limited 5.75% 06/10/2028	839.987	0,38	
GBP	1.277.000	Zenith Finco plc 6.50% 30/06/2027	1.175.121	0,53	Total de Australia			839.987	0,38	
Total de Reino Unido			48.511.266	21,85	BERMUDAS					
ESTADOS UNIDOS					USD	1.991.000	Bacardi Limited 4.70% 15/05/2028	1.790.377	0,81	
USD	932.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2030	860.358	0,39	Total de Bermudas			1.790.377	0,81	
USD	2.728.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2033	2.466.356	1,10	DINAMARCA					
EUR	1.402.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 2.00% 01/09/2028	1.166.959	0,53	USD	2.005.000	Danske Bank A/S 1.55% 10/09/2027	1.658.488	0,75	
USD	1.653.000	Bank of America Corp. FRN 22/04/2032	1.229.102	0,55	Total de Dinamarca			1.658.488	0,75	
EUR	1.430.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 2.38% 01/03/2028	1.202.117	0,54	PAÍSES BAJOS					
EUR	3.244.000	Digital Euro Finco LLC 1.13% 09/04/2028	2.767.409	1,25	GBP	786.000	GTCR W-2 Merger Sub LLC 8.50% 15/01/2031	925.767	0,42	
USD	1.059.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2032	789.693	0,36	USD	2.956.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	2.791.972	1,26	
USD	395.000	L3Harris Technologies Inc. 5.40% 31/07/2033	358.799	0,16	Total de Países Bajos			3.717.739	1,68	
USD	526.000	Occidental Petroleum Corp. 6.63% 01/09/2030	503.058	0,23	ESTADOS UNIDOS					
USD	1.281.000	Occidental Petroleum Corp. 8.88% 15/07/2030	1.357.866	0,61	USD	1.140.000	ERAC USA Finance LLC 4.90% 01/05/2033	1.012.630	0,46	
USD	1.238.000	Plains All American Pipeline LP 3.55% 15/12/2029	1.006.029	0,45	USD	1.219.000	Jersey Central Power & Light Company 2.75% 01/03/2032	903.225	0,41	
EUR	1.455.000	Silgan Holdings Inc. 3.25% 15/03/2025	1.417.980	0,63						

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)				Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios				
Bonos (continuación)				Fondos				
ESTADOS UNIDOS (continuación)				IRLANDA				
USD	831.000	Occidental Petroleum Corp. 7.88% 15/09/2031	851.691	0,38	310.248	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	357.661	0,17
					10.297	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	9.725	0,00
		Total de Estados Unidos	2.767.546	1,25	80.734	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	8.114.638	3,65
		Total de bonos	10.774.137	4,87	33.816	Insight Liquidity Funds plc	38.984	0,02
		Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente	10.774.137	4,87		Total de Irlanda	8.521.008	3,84
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario				Total de fondos				
Bonos				Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios				
PORTUGAL				Valor total de las inversiones				
EUR	12.900.000	Banco Espirito Santo SA 0.00% 21/01/2099**	2.193.000	0,99	(Coste total: 238.376.799 EUR)			
		Total de Portugal	2.193.000	0,99	<i>* Diferencias menores debido al redondeo.</i>			
REINO UNIDO				<i>** Titulo a su valor razonable.</i>				
GBP	1.589.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	1.723.305	0,79				
GBP	1.809.000	Sherwood Financing plc 6.00% 15/11/2026	1.780.003	0,81				
		Total de Reino Unido	3.503.308	1,60				
ESTADOS UNIDOS								
EUR	1.336.000	Emerald Debt Merger Sub LLC 6.38% 15/12/2030	1.333.210	0,60				
EUR	613.000	Olympus Water US Holding Corp. 9.63% 15/11/2028	613.364	0,28				
		Total de Estados Unidos	1.946.574	0,88				
		Total de bonos	7.642.882	3,47				
		Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario	7.642.882	3,47				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Fund

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2023

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*				
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)							
Bonos				Bonos (continuación)							
AUSTRALIA				IRLANDA							
EUR	174.000	APT Pipelines Limited 1.25% 15/03/2033	126.337	1,52	EUR	125.000	Aib Group plc FRN 30/05/2031	115.585	1,39		
EUR	128.000	AusNet Services Holdings Pty Limited 0.63% 25/08/2030	100.369	1,21	EUR	100.000	Bank of Ireland Group plc FRN 04/07/2031	99.960	1,20		
EUR	100.000	NBN Company Limited 4.38% 15/03/2033	98.548	1,19	EUR	100.000	Permanent TSB Group Holdings plc FRN 25/04/2028	101.249	1,22		
Total de Australia		325.254	3,92	Total de Irlanda		316.794	3,81				
BÉLGICA				ITALIA							
EUR	100.000	Elia Transmission Belgium SA 0.88% 28/04/2030	81.890	0,99	EUR	140.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.25% 25/01/2032	112.440	1,35		
EUR	200.000	Kbc Group NV - Perp FRN	172.052	2,07	Total de Italia		112.440	1,35			
Total de Bélgica		253.942	3,06	LUXEMBURGO							
FRANCIA				PAÍSES BAJOS							
EUR	100.000	BNP Paribas SA FRN 26/09/2032	98.459	1,19	EUR	200.000	Aroundtown SA 1.45% 09/07/2028	145.542	1,75		
USD	300.000	BNP Paribas SA - Perp FRN	231.175	2,78	EUR	100.000	Grand City Properties SA 0.13% 11/01/2028	76.574	0,92		
EUR	200.000	BPCE SA FRN 13/10/2046	146.554	1,76	EUR	100.000	Grand City Properties SA - Perp FRN	47.938	0,58		
EUR	100.000	Credit Agricole SA 4.00% 18/01/2033	97.642	1,18	Total de Luxemburgo		270.054	3,25			
EUR	100.000	La Banque Postale SA FRN 26/01/2031	89.830	1,08	PAÍSES BAJOS						
EUR	100.000	Praemia Healthcare SACA 5.50% 19/09/2028	99.633	1,20	EUR	100.000	ASR Nederland NV FRN 07/12/2043	102.875	1,24		
GBP	100.000	Suez SACA 6.63% 05/10/2043	115.286	1,39	EUR	200.000	Cooperatieve Rabobank UA - Perp FRN	150.999	1,82		
Total de Francia		878.579	10,58	EUR	100.000	ING Groep NV FRN 23/05/2034	98.742	1,19			
ALEMANIA				USD	200.000	ING Groep NV - Perp FRN	137.219	1,65			
EUR	200.000	Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	161.935	1,95	EUR	287.000	Stedin Holding NV - Perp FRN	249.061	2,99		
EUR	200.000	Amprion GmbH 0.63% 23/09/2033	142.200	1,70	EUR	100.000	Telefonica Europe BV - Perp FRN	98.876	1,19		
EUR	100.000	Bayer AG FRN 25/09/2083	99.013	1,19	EUR	100.000	TenneT Holding BV 4.50% 28/10/2034	105.407	1,27		
EUR	100.000	Commerzbank AG FRN 29/12/2031	83.506	1,01	EUR	100.000	Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	75.226	0,91		
EUR	100.000	Deutsche Bank AG FRN 19/11/2030	79.354	0,96	Total de Países Bajos		1.018.405	12,26			
EUR	100.000	Hamburg Commercial Bank AG 4.88% 30/03/2027	98.998	1,19	SINGAPUR						
EUR	650.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.01% 05/05/2027	577.669	6,95	USD	36.000	Pfizer Investment Enterprises Pte Limited 4.75% 19/05/2033	32.215	0,39		
EUR	100.000	Vier Gas Transport GmbH 4.63% 26/09/2032	101.124	1,22	Total de Singapur		32.215	0,39			
EUR	54.000	Volkswagen Leasing GmbH 4.75% 25/09/2031	53.049	0,64							
Total de Alemania		1.396.848	16,81								

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Fund

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)						
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)						
SUIZA				ESTADOS UNIDOS (continuación)						
EUR	100.000	Credit Suisse AG 0.25% 01/09/2028	82.193	0,99	USD	69.000	Plains All American Pipeline LP 3.55% 15/12/2029	56.071	0,67	
Total de Suiza			82.193	0,99	GBP	65.000	Time Warner Cable Inc. 5.75% 02/06/2031	70.021	0,84	
REINO UNIDO				Total de Estados Unidos						
GBP	100.000	Arqiva Financing plc 7.21% 30/06/2028	118.551	1,43	Total de Estados Unidos			786.615	9,47	
EUR	100.000	Barclays plc FRN 12/05/2032	75.025	0,90	Total de bonos			7.381.697	88,84	
GBP	100.000	Co-Operative Bank Finance plc FRN 06/04/2027	105.579	1,27	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				7.381.697	88,84
EUR	100.000	DS Smith plc 4.50% 27/07/2030	97.970	1,18	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente					
EUR	340.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	333.070	4,00	Bonos					
GBP	100.000	HSBC Holdings plc FRN 16/11/2034	119.381	1,44	PAÍSES BAJOS					
EUR	200.000	HSBC Holdings plc - Perp FRN	167.131	2,01	USD	50.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	47.226	0,57	
GBP	36.233	Marston's Issuer plc FRN 15/10/2027	39.243	0,47	Total de Países Bajos			47.226	0,57	
GBP	78.890	Mitchells & Butlers Finance plc FRN 15/12/2028	84.034	1,01	ESTADOS UNIDOS					
EUR	100.000	National Grid Electricity Distribution East Midlands plc 3.95% 20/09/2032	95.275	1,15	USD	80.000	ERAC USA Finance LLC 4.90% 01/05/2033	71.062	0,86	
GBP	100.000	Nationwide Building Society 6.13% 21/08/2028	116.710	1,40	USD	60.000	Jersey Central Power & Light Company 2.75% 01/03/2032	44.457	0,54	
GBP	60.000	Santander UK plc - Perp 10.06% 7.62% 13/07/2039	91.579	1,10	Total de Estados Unidos			115.519	1,40	
GBP	70.578	Tesco Property Finance 1 plc	87.089	1,05	Total de bonos			162.745	1,97	
EUR	200.000	Thames Water Utilities Finance plc 0.19% 23/10/2023	199.109	2,39	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente					
EUR	100.000	Thames Water Utilities Finance plc 0.88% 31/01/2028	82.189	0,99	ESTADOS UNIDOS					
EUR	100.000	Virgin Money UK plc FRN 29/10/2028	96.423	1,16	USD	84.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2030	77.543	0,93	
Total de Reino Unido			1.908.358	22,95	USD	202.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2033	182.626	2,20	
ESTADOS UNIDOS				ESTADOS UNIDOS						
USD	84.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2030	77.543	0,93	USD	107.000	Bank of America Corp. FRN 22/04/2032	79.561	0,96	
USD	202.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2033	182.626	2,20	EUR	189.000	Digital Euro Finco LLC 1.13% 09/04/2028	161.233	1,94	
USD	107.000	Bank of America Corp. FRN 22/04/2032	79.561	0,96	USD	51.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2032	38.031	0,46	
EUR	189.000	Digital Euro Finco LLC 1.13% 09/04/2028	161.233	1,94	USD	27.000	L3Harris Technologies Inc. 5.40% 31/07/2033	24.526	0,30	
USD	51.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2032	38.031	0,46						
USD	27.000	L3Harris Technologies Inc. 5.40% 31/07/2033	24.526	0,30						

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Fund

Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
2.512	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	252.517	3,04
	Total de Irlanda	252.517	3,04
	Total de fondos	252.517	3,04
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	252.517	3,04
	Valor total de las inversiones	7.796.959	93,85

(Coste total: 8.504.824 EUR)

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2023

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
DINAMARCA				SUECIA (continuación)			
25.912	Novo Nordisk A/S	2.237.465	4,86	30.402	Sandvik AB	532.843	1,16
Total de Dinamarca		2.237.465	4,86	Total de Suecia		2.674.770	5,81
FRANCIA				SUIZA			
3.270	Air Liquide SA	522.677	1,13	66.416	ABB Limited - Reg	2.249.195	4,88
9.634	Compagnie de Saint-Gobain	547.982	1,19	15.680	Compagnie Financiere		
1.191	Hermes International	2.060.191	4,47		Richemont SA - Reg	1.813.195	3,94
4.748	Legrand SA	414.500	0,90	5.611	Novartis AG - Reg	543.810	1,18
5.700	L'Oreal SA	2.241.240	4,87	3.992	Vat Group AG	1.356.022	2,94
2.792	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	2.000.189	4,34	Total de Suiza		5.962.222	12,94
2.411	Pernod-Ricard SA	380.577	0,83	REINO UNIDO			
14.652	Schneider Electric SE	2.300.071	4,99	103.976	3i Group plc	2.484.818	5,39
Total de Francia		10.467.427	22,72	1.348	Astrazeneca plc	172.525	0,37
ALEMANIA				15.696	Compass Group	361.894	0,79
10.464	Beiersdorf AG	1.278.178	2,77	7.260	InterContinental Hotels Group plc	508.363	1,10
11.977	Hannover Rueckversicherung AG - Reg	2.490.018	5,40	70.485	Rentokil Initial plc	495.828	1,08
14.346	Infineon Technologies AG	449.819	0,98	Total de Reino Unido		4.023.428	8,73
7.022	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG - Reg	2.591.820	5,63	Total de renta variable		43.279.407	93,93
17.166	SAP SE	2.108.328	4,58	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa		43.279.407	93,93
Total de Alemania		8.918.163	19,36	Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
ITALIA				Fondos			
36.750	Moncler SpA	2.024.190	4,39	IRLANDA			
Total de Italia		2.024.190	4,39	20.038	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	2.014.024	4,37
PAÍSES BAJOS				Total de Irlanda			
5.403	ASM International NV	2.147.692	4,65	Total de fondos		2.014.024	4,37
3.623	ASML Holding NV	2.025.619	4,40	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		2.014.024	4,37
21.154	BE Semiconductor Industries	1.967.322	4,27	Valor total de las inversiones		45.293.431	98,30
14.238	Davide Campari-Milano NV	158.967	0,34	(Coste total: 43.880.013 EUR)			
10.542	STMicroelectronics NV	432.064	0,94	<i>* Diferencias menores debido al redondeo.</i>			
Total de Países Bajos		6.731.664	14,60				
ESPAÑA							
6.803	Inditex SA	240.078	0,52				
Total de España		240.078	0,52				
SUECIA							
167.318	Atlas Copco AB	2.141.927	4,65				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2023

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
CANADÁ				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
7.936	RB Global Inc.	496.000	0,97	6.246	Microsoft Corp.	1.972.174	3,86
	Total de Canadá	496.000	0,97	2.437	Morningstar Inc.	570.842	1,12
				7.236	Nike Inc.	691.906	1,36
				121.542	NOV Inc.	2.540.228	4,97
				3.495	Procter & Gamble Company	509.781	1,00
				10.713	Prologis Inc.	1.202.106	2,35
				13.792	Qualcomm Inc.	1.531.739	3,00
				3.178	S&P Global Inc.	1.161.273	2,28
				2.397	Salesforce.com Inc.	486.063	0,95
				22.412	Schnitzer Steel Industries Inc.	624.174	1,22
				3.793	Sherwin-Williams Company	967.405	1,89
				5.579	Stanley Black & Decker Inc.	466.293	0,91
				17.448	Teradata Corp.	785.509	1,54
				7.053	Transunion	506.335	0,99
				6.535	Trimble Inc.	351.975	0,69
				17.090	Uber Technologies Inc.	785.970	1,53
				4.309	United Parcel Service Inc.	671.644	1,32
				13.338	Utz Brands Inc.	179.130	0,35
				3.435	Vertex Pharmaceuticals Inc.	1.194.488	2,34
				13.690	Voya Financial Inc.	909.701	1,78
				13.945	Walt Disney Company	1.130.243	2,21
				15.181	WillScot Mobile Mini Holdings Corp.	631.378	1,24
					Total de Estados Unidos	47.416.560	92,87
					Total de renta variable	49.854.508	97,64
					Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	49.854.508	97,64
					Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		
					Fondos		
					IRLANDA		
				204.812	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	204.812	0,40
					Total de Irlanda	204.812	0,40
					Total de fondos	204.812	0,40
					Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	204.812	0,40
					Valor total de las inversiones	50.059.320	98,04
					(Coste total: 49.742.293 USD)		

* Diferencias menores debido al redondeo.

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2023

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
AUSTRALIA				JAPÓN			
4.091	CSL Limited	662.195	0,82	2.000	Keyence Corp.	743.843	0,92
	Total de Australia	662.195	0,82	10.500	Sony Group Corp.	861.250	1,06
CANADÁ				PAÍSES BAJOS			
20.240	Nutrien Limited	1.255.718	1,55	10.742	Akzo Nobel NV	778.829	0,96
6.059	Waste Connections Inc.	813.724	1,00		Total de Países Bajos	778.829	0,96
	Total de Canadá	2.069.442	2,55	NORUEGA			
DINAMARCA				SINGAPUR			
9.008	Novo Nordisk A/S	823.525	1,02	57.500	DBS Group Holdings Limited	1.417.173	1,75
	Total de Dinamarca	823.525	1,02		Total de Singapur	1.417.173	1,75
FRANCIA				SUIZA			
31.510	AXA SA	940.119	1,16	5.286	DSM-Firmenich AG	448.452	0,55
4.401	EssilorLuxottica SA	769.573	0,95	2.042	Lonza Group AG - Reg	950.017	1,17
1.893	L'Oreal SA	788.057	0,97		Total de Suiza	1.398.469	1,72
902	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	684.157	0,84	TAIWÁN			
5.057	Schneider Electric SE	840.486	1,04	102.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	1.652.551	2,04
22.324	TotalEnergies SE	1.472.730	1,82		Total de Taiwán	1.652.551	2,04
	Total de Francia	5.495.122	6,78	REINO UNIDO			
ALEMANIA				ESTADOS UNIDOS			
5.705	Adidas AG	1.006.413	1,25	10.878	Abbott Laboratories	1.053.534	1,30
	Total de Alemania	1.006.413	1,25	674	Adobe Systems Inc.	343.673	0,42
HONG KONG				9.447	Advanced Micro Devices Inc.	971.341	1,20
114.800	AIA Group Limited	935.921	1,15	18.341	Amazon.com Inc.	2.331.508	2,87
	Total de Hong Kong	935.921	1,15	291	Autodesk Inc.	60.211	0,07
INDIA				1.681	Cooper Companies Inc.	534.575	0,66
295.602	HDFC Bank Limited	5.433.076	6,70	REINO UNIDO (continuación)			
	Total de India	5.433.076	6,70	20.454	Anglo American plc	565.585	0,70
INDONESIA				12.101	Ashtead Group plc	738.789	0,91
1.684.449	Bank Rakyat Indonesia	569.441	0,70	22.167	Diageo plc	820.877	1,01
	Total de Indonesia	569.441	0,70	32.262	Genus plc	825.350	1,02
IRLANDA				17.711	Reckitt Benckiser Group plc	1.252.498	1,55
37.563	CRH plc	2.082.394	2,57	58.699	Shell plc	1.867.071	2,30
3.920	Linde plc	1.459.612	1,80		Total de Reino Unido	6.070.170	7,49
	Total de Irlanda	3.542.006	4,37				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha

Estado de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Renta variable (continuación)				Fondos			
ESTADOS UNIDOS (continuación)				IRLANDA			
5.677	CrowdStrike Holdings Inc. - A	950.216	1,17	1.814.075	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	1.814.076	2,24
7.257	Dexcom Inc.	677.078	0,84		Total de Irlanda	1.814.076	2,24
13.904	Ecolab Inc.	2.355.337	2,91		Total de fondos	1.814.076	2,24
9.095	Electronic Arts Inc.	1.095.038	1,35		Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	1.814.076	2,24
2.808	Elevance Health Inc.	1.222.659	1,51		Valor total de las inversiones	72.632.883	89,62
1.650	Eli Lilly & Company	886.265	1,09		(Coste total: 68.480.305 USD)		
560	Equinix Inc.	406.706	0,50				
6.206	Hess Corp.	949.518	1,17				
1.705	Humana Inc.	829.517	1,02				
17.763	IntercontinentalExchange Inc.	1.954.285	2,41				
2.190	Intuit Inc.	1.118.958	1,39				
13.627	Marvell Technology Inc.	737.630	0,91				
3.120	Mastercard Inc. - A	1.235.239	1,53				
14.375	Micron Technology Inc.	977.931	1,21				
2.918	Microsoft Corp.	921.359	1,14				
10.588	NextEra Energy Inc.	606.587	0,75				
9.005	Nvidia Corp.	3.917.084	4,84				
8.085	ON Semiconductor Corp.	751.501	0,93				
9.528	PepsiCo Inc.	1.614.424	1,99				
10.100	Qualcomm Inc.	1.121.706	1,38				
2.395	Thermo Fisher Scientific Inc.	1.212.277	1,49				
22.533	T-Mobile USA Inc.	3.155.747	3,89				
15.502	Trimble Inc.	834.938	1,03				
8.416	Uber Technologies Inc.	387.052	0,48				
3.855	Union Pacific Corp.	784.995	0,97				
	Total de Estados Unidos	35.998.889	44,42				
	Total de renta variable	70.818.807	87,38				
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	70.818.807	87,38				

* Diferencias menores debido al redondeo.

Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2023

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo*		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)					
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)					
ESTADOS UNIDOS				ESTADOS UNIDOS (continuación)					
USD	26.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 02/11/2023	25.881.674	14,84	USD	6.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 28/11/2023	5.949.436	3,41
Total de Estados Unidos			25.881.674	14,84	Total de Estados Unidos			144.354.922	82,79
Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				25.881.674	14,84	Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda			
Instrumentos estructurados - Materias primas				Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente					
IRLANDA				Valor total de las inversiones					
	1.563	Invesco Physical Gold ETC 0.00%	279.793	0,16	(Coste total: 169.749.921 USD)				
Total de Irlanda			279.793	0,16	170.516.389				97,79
Total de instrumentos estructurados - Materias primas				279.793	0,16	* Diferencias menores debido al redondeo.			
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				26.161.467	15,00				
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente									
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda									
ESTADOS UNIDOS									
USD	16.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 12/10/2023	15.976.555	9,16					
USD	31.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 19/10/2023	30.922.633	17,73					
USD	31.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 26/10/2023	30.890.982	17,72					
USD	21.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 07/11/2023	20.889.068	11,98					
USD	20.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 14/11/2023	19.873.748	11,40					
USD	20.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 21/11/2023	19.852.500	11,39					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Notas a los estados financieros

1 GENERAL

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

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

Acontecimientos significativos durante el periodo:

Nuevo folleto

Se ha publicado un nuevo Folleto en septiembre de 2023.

Reducción de comisiones

A partir del 20 de septiembre de 2023, la Comisión de gestión de activos de la Clase N de Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies se ha reducido del 0,55% al 0,45%.

Cierre de carteras

Con efecto a partir del 28 de abril de 2023, Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return Portfolio se puso en liquidación y el reembolso final se produjo el mismo día.

Con efecto a partir del 13 de julio de 2023, Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities Portfolio y Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha Portfolio se pusieron en liquidación. Los reembolsos finales se produjeron el 21 de julio de 2023.

Lanzamiento de clases de acciones

Las siguientes clases de acciones se lanzaron durante el periodo finalizado el 30 de septiembre de 2023:

Clase de Acciones	Cartera	Fecha Efectiva
XVC	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	14 de septiembre de 2023
NE	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	21 de septiembre de 2023
NEP	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	21 de septiembre de 2023
IG	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	8 de junio de 2023
AE	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	13 de abril de 2023
IFH	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	6 de abril de 2023
NE	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	21 de septiembre de 2023
ZE	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	13 de abril de 2023
ASC	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	6 de abril de 2023

A 30 de septiembre de 2023, las Carteras activas de la SICAV son las siguientes:

Las Carteras de bonos:

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

Las Carteras de asignación de activos:

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

Las Carteras de renta variable:

- Threadneedle (Lux) - Global Focus¹
- Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities¹
- Threadneedle (Lux) - Global Equity Income

Notas a los estados financieros

(continuación)

1 GENERAL

(continuación)

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

Las Carteras de rendimiento absoluto:

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

Las Carteras de Extended Alpha:

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

La Cartera de especialistas:

- Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

¹ A 30 de septiembre de 2023, estas Carteras han sido autorizadas por la Comisión de Valores y Futuros en Hong Kong y están disponibles al público de Hong Kong.

2 RESUMEN DE POLÍTICAS CONTABLES SIGNIFICATIVAS

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

Los estados financieros se presentan sobre la base del Valor liquidativo de las Carteras, que se calcula a 30 de septiembre de 2023. El último Valor liquidativo oficial de las Carteras correspondientes se ha calculado a partir del 29 de septiembre de 2023.

Los estados financieros se preparan con arreglo a los requisitos legales y reglamentarios de Luxemburgo relativos a los fondos de inversión bajo los criterios de contabilidad de la empresa en funcionamiento, excepto en el caso de Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return Portfolio, que se puso en liquidación el 28 de abril de 2023, así como de Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities Portfolio y Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha Portfolio, que se pusieron en liquidación el 13 de julio de 2023. Como tal, los estados financieros de estas Carteras se han preparado sobre una base de empresa no consolidada, y cualquier gasto adicional respecto al cierre de estas Carteras correrá a cargo de la Sociedad Gestora.

1) Valoración de valores

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

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

Notas a los estados financieros

(continuación)

2 RESUMEN DE POLÍTICAS CONTABLES SIGNIFICATIVAS

(continuación)

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

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

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

II) *Contratos de divisas a plazo*

Con el fin de cubrir el riesgo de divisa específico o la inversión en otras divisas, la SICAV podrá celebrar contratos de divisas a plazo. Al final del periodo, los contratos abiertos de divisas a plazo se valoran a los tipos a plazo aplicables para el periodo restante hasta el vencimiento. El movimiento neto en la ganancia/(pérdida) no realizada que surge de los contratos de divisas a plazo se registra en el Estado de operaciones y variaciones en el patrimonio neto. Los contratos vigentes a 30 de septiembre de 2023 figuran en la Nota 9.

III) *Contratos de futuros*

La SICAV podrá celebrar contratos de futuros. Los contratos de futuros abiertos se valoran a los precios de la bolsa para la cual se negocian los contratos. El movimiento neto en la ganancia/(pérdida) no realizada que surge de los contratos de futuros se registra en el Estado de operaciones y variaciones en el patrimonio neto. Los contratos vigentes a 30 de septiembre de 2023 figuran en la Nota 11.

IV) *Swaps*

La SICAV podrá participar en swaps de tipos de interés («IRS», por sus siglas en inglés), swaps de incumplimiento crediticio («CDS», por sus siglas en inglés) y swaps de rentabilidad total («SRT»). Los IRS se valoran sobre la base de su valor de mercado establecido por referencia a la curva del tipo de interés aplicable. Los CDS se valoran por referencia al valor presente neto de los flujos de caja futuros esperados según los tipos de interés del mercado y la tasa de incumplimiento y recuperación esperada del mercado del activo subyacente. Un pago por adelantado, si lo hubiera, realizado por la SICAV se registra como un activo en el Estado del patrimonio neto. Un pago por adelantado, si lo hubiera, recibido por la SICAV se registra como un pasivo en el Estado del patrimonio neto. Los SRT se valoran por referencia al valor de mercado en función del valor de mercado del activo subyacente. El movimiento neto en la ganancia o pérdida no realizada que surge de los swaps se registra en el Estado de operaciones y variaciones en el patrimonio neto. Los contratos vigentes a 30 de septiembre de 2023 figuran en la Nota 10. Los dividendos a pagar en swaps de posiciones cortas, si existen, se registran como un pasivo en el Estado del patrimonio neto.

V) *Opciones*

Las opciones negociadas en un mercado regulado se valoran al precio de mercado en la fecha de valoración. Dichas opciones abiertas a 30 de septiembre de 2023 se muestran en el Programa de inversiones. Las opciones de venta libre («OTC», por sus siglas en inglés) se valoran según los precios recibidos de los agentes o los modelos de precios de terceros. Dichas opciones abiertas a 30 de septiembre de 2023 se muestran en la Nota 12. Las ganancias o pérdidas no realizadas que surgen en el momento de la presentación del informe de la valoración de las operaciones con opciones se tienen en cuenta en el Estado de operaciones y variaciones en el patrimonio neto.

VI) *Conversión de divisas*

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

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

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

El Estado consolidado del patrimonio neto y el Estado de operaciones y variaciones en el patrimonio neto se presentan en USD en función de los tipos de cambio vigentes en la fecha del Estado del patrimonio neto. Los tipos de cambio utilizados a 30 de septiembre de 2023 son: 1 USD = 1,549427 AUD, 1 USD = 0,944510 EUR, 1 USD = 0,819303 GBP, 1 USD = 0,914800 CHF, 1 USD = 10,864251 SEK, 1 USD = 7,043196 DKK, 1 USD = 10,640901 NOK, 1 USD = 7,831835 HKD 1 USD = 1,364901 SGD.

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

Notas a los estados financieros

(continuación)

2 RESUMEN DE POLÍTICAS CONTABLES SIGNIFICATIVAS

(continuación)

VII) Efectivo en el banco

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

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

VIII) Depósitos a plazo

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

IX) Transacciones de inversión e ingresos por inversiones

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

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

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

X) Política de distribución

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

XI) Reembolsos de comisiones de gestión de activos

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

3 TRIBUTACIÓN

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

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

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

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

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

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

4 COMISIONES VARIAS

Las comisiones varias se componen principalmente de las indemnizaciones a los inversores perjudicados por un error en el VL.

5 OPERACIONES VINCULADAS

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

Para el periodo cerrado a 30 de septiembre de 2023, la SICAV no realizó operaciones con personas relacionadas.

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 OPERACIONES VINCULADAS

(continuación)

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

Ni la Sociedad Gestora ni TAML obtuvieron comisiones relacionadas con operaciones de corretaje. Consulte también la nota 6 para obtener detalles sobre los acuerdos de reparto de comisiones.

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

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

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

Todos los gastos incurridos en el funcionamiento de la SICAV y definidos a continuación (en adelante, «Gastos operativos», «Comisión de gestión de activos» o «Cargos de Cartera», juntos, los «Gastos») se fijan a las tasas mostradas en las tablas de la página 219 en adelante. Todos los gastos se acumulan diariamente en función del Valor liquidativo de la Clase de Acciones correspondiente en la Cartera correspondiente.

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

Además, la Sociedad Gestora tiene derecho a recibir una comisión de gestión de activos (la «Comisión de gestión de activos») tal como se describe más detalladamente en las tablas de la página 219 en adelante que se acumulan diariamente y se pagan mensualmente. Las Acciones X y las Acciones 4 están exentas del pago de una Comisión de gestión de activos. Para evitar dudas, los Gastos operativos no incluyen las Comisiones de gestión de activos ni las comisiones de rendimiento, que son independientes y distintas.

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

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

ACCIONES A:

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

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

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 OPERACIONES VINCULADAS

(continuación)

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de bonos				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,60%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,60%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	1,25%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	0,75%	0,15%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	0,40%	0,15%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	0,90%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	1,35%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,35%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	1,30%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	1,25%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	0,90%	0,20%	USD
Carteras de asignación de activos				
	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return*	1,25%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	1,35%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	1,25%	0,30%	USD
Carteras de renta variable				
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities*	1,50%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	1,50%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	1,50%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	1,50%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	1,50%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - American	1,50%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,50%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	1,50%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	1,50%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	1,50%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	1,50%	0,35%	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,55%	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	1,30%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	1,50%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	1,50%	0,35%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	1,50%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	1,50%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	1,65%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	1,50%	0,30%	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	1,50%	0,30%	GBP
Carteras de rendimiento absoluto				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha*	1,50%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	1,00%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,90%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	1,50%	0,35%	EUR
Carteras de Extended Alpha				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	1,50%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	1,50%	0,30%	USD
Cartera de especialistas				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	1,00%	0,20%	USD

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 OPERACIONES VINCULADAS

(continuación)

ACCIONES B:

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

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

ACCIONES D:

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

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

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de bonos				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	1,35%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	1,45%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	1,45%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,45%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	1,45%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	1,45%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	1,20%	0,20%	USD
Carteras de asignación de activos				
	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return*	2,00%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	2,00%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	2,00%	0,30%	USD
Carteras de renta variable				
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	2,25%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	2,25%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	2,00%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	2,00%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - American	1,85%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	2,25%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	2,00%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	2,25%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	2,00%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	2,00%	0,35%	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,75%	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	1,50%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	1,85%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	2,40%	0,35%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	2,00%	0,35%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	2,25%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	2,00%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	2,25%	0,35%	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	2,25%	0,30%	GBP

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 OPERACIONES VINCULADAS

(continuación)

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de rendimiento absoluto				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha*	2,00%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	1,45%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	2,00%	0,35%	EUR
Carteras de Extended Alpha				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	2,00%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	2,00%	0,30%	USD
Cartera de especialistas				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	1,25%	0,20%	USD

ACCIONES I:

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

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de bonos				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,40%	0,10%	USD
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,40%	0,10%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,55%	0,10%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	0,40%	0,10%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	0,30%	0,10%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	0,40%	0,10%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	0,65%	0,10%	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	0,65%	0,10%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	0,65%	0,10%	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	0,55%	0,10%	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	0,40%	0,10%	USD
Cartera de asignación de activos				
	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	0,75%	0,20%	USD
Carteras de renta variable				
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities*	0,65%	0,10%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	0,75%	0,10%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	0,75%	0,10%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,75%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	0,75%	0,10%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	0,75%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - American	0,70%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	0,80%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	0,75%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	0,75%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	0,75%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	0,80%	0,25%	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,25%	0,10%	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	0,65%	0,10%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	0,50%	0,15%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	0,85%	0,25%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	0,75%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	0,75%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	0,75%	0,20%	EUR

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 OPERACIONES VINCULADAS

(continuación)

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de renta variable				
<i>(continuación)</i>				
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	0,75%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	0,85%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,65%	0,20%	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,65%	0,20%	GBP
Carteras de rendimiento absoluto				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha*	0,75%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	0,50%	0,10%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,35%	0,10%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	0,75%	0,20%	EUR
Carteras de Extended Alpha				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75%	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	0,75%	0,15%	USD
Cartera de especialistas				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	0,80%	0,10%	USD

ACCIONES J:

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

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

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Cartera de rendimiento absoluto				
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,25%	0,10%	EUR

ACCIONES L:

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

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

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

ACCIONES N:

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

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 OPERACIONES VINCULADAS

(continuación)

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

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de bonos				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,30%	0,10%	USD
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,08%	0,10%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	0,30%	0,10%	EUR
Carteras de renta variable				
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	0,45% ¹	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	0,40%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,10%	0,10%	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,60%	0,08%	GBP
Cartera de especialistas				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	0,45%	0,10%	USD

ACCIONES S:

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

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

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Cartera de bonos				
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,50%	0,20%	USD

ACCIONES T:

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

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

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

ACCIONES W:

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

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

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 OPERACIONES VINCULADAS

(continuación)

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de bonos				
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	1,00%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,00%	0,20%	USD
Cartera de asignación de activos				
	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	1,40%	0,35%	USD
Carteras de renta variable				
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	1,40%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - American	1,15%	0,35%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,40%	0,35%	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	1,40%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	1,55%	0,35%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	1,65%	0,35%	USD

ACCIONES X:

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

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

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 OPERACIONES VINCULADAS

(continuación)

ACCIONES Y:

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

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

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Cartera de rendimiento absoluto				
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,35%	0,15%	EUR

ACCIONES Z:

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

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

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

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 OPERACIONES VINCULADAS

(continuación)

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

ACCIONES 1:

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

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

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

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 OPERACIONES VINCULADAS

(continuación)

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de Extended Alpha				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	1,50%	0,19%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	1,50%	0,19%	USD

ACCIONES 2:

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

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

ACCIONES 3:

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

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

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

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 OPERACIONES VINCULADAS

(continuación)

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

ACCIONES 4:

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

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

ACCIONES 8:

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

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de bonos				
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,50%	0,12%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,75%	0,11%	EUR
Carteras de renta variable				
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	1,00%	0,14%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	1,00%	0,11%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	1,00%	0,11%	USD
	Threadneedle (Lux) - American	1,00%	0,10%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,00%	0,10%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	1,00%	0,11%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	1,00%	0,13%	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	1,00%	0,12%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	1,00%	0,13%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	1,00%	0,11%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	1,00%	0,10%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	1,00%	0,11%	EUR

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 OPERACIONES VINCULADAS

(continuación)

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Cartera de rendimiento absoluto				
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	0,50%	0,10%	EUR
Carteras de Extended Alpha				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75%	0,12%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	0,75%	0,12%	USD

ACCIONES 9:

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

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de bonos				
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,50%	0,10%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,60%	0,10%	EUR
Carteras de renta variable				
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,75%	0,14%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	0,75%	0,10%	USD
	Threadneedle (Lux) - American	0,75%	0,09%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	0,75%	0,08%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	0,75%	0,14%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	0,75%	0,16%	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	0,75%	0,10%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	0,75%	0,16%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	0,75%	0,12%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	0,75%	0,09%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	0,75%	0,14%	EUR
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,75%	0,08%	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,75%	0,09%	GBP
Cartera de Extended Alpha				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75%	0,15%	USD

* Consulte la nota 1.

¹ 0,55% hasta el 19 de septiembre de 2023.

6 ACUERDOS DE REPARTO DE COMISIONES

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

Cualquier acuerdo de reparto de comisiones suscrito por la Sociedad Gestora o un Subasesor operará bajo las siguientes condiciones: (i) la Sociedad Gestora o el Subasesor actuarán en todo momento en interés de la SICAV y de sus Accionistas cuando celebren acuerdos de reparto de comisiones; (ii) los servicios prestados estarán directamente relacionados con las actividades de la Sociedad Gestora o del Subasesor; (iii) la Sociedad Gestora o el Subasesor asignarán las comisiones de corretaje sobre las operaciones de cartera de la SICAV a los corredores de bolsa/agentes que sean entidades y no a personas físicas; (iv) los acuerdos de reparto de comisiones no serán un factor determinante en la selección de los corredores de bolsa/agentes; (v) la Sociedad Gestora o el Subasesor presentarán informes a los Consejeros con respecto a los acuerdos de reparto de comisiones, incluida la naturaleza de los servicios; (vi) ni la Sociedad Gestora, ni el Subasesor ni ninguna de las personas vinculadas a ellos podrán retener reembolsos en efectivo o de

Notas a los estados financieros

(continuación)

6 ACUERDOS DE REPARTO DE COMISIONES

(continuación)

otro tipo por parte de los corredores de bolsa/agentes; (vii) los bienes o servicios recibidos serán de beneficio demostrable para los Accionistas; y (viii) la divulgación periódica se hará en el informe anual de la SICAV en forma de declaración en la que se describa cualquier acuerdo de reparto de comisiones, incluida una descripción de los bienes o servicios recibidos. Los bienes y servicios recibidos pueden incluir: investigación que pueda agregar valor al proceso de toma de decisiones de un Subasesor y servicios de ejecución que mejoren la capacidad del Subasesor para ejecutar transacciones.

Solo el Subasesor Columbia Management Investment Advisors, LLC puede celebrar acuerdos de reparto de comisiones.

7 DIVIDENDOS

La SICAV declaró los siguientes dividendos durante el periodo finalizado el 30 de septiembre de 2023:

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa de la clase de acciones	Importe por Acción (en la divisa de la clase de acciones)	Importe total (en la divisa de la Cartera)
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	Clase AEC	26/06/2023	EUR	0,084	146.449
	Clase AEC	25/09/2023	EUR	0,094	162.588
	Clase AUP	26/06/2023	USD	0,099	12.213
	Clase AUP	25/09/2023	USD	0,109	13.681
	Clase DEC	26/06/2023	EUR	0,075	7.027
	Clase DEC	25/09/2023	EUR	0,085	7.745
	Clase DUP	26/06/2023	USD	0,088	4.144
	Clase DUP	25/09/2023	USD	0,096	2.813
	Clase IEC	26/06/2023	EUR	0,083	1.338.998
	Clase IEC	25/09/2023	EUR	0,093	1.974.347
	Clase IEP	26/06/2023	EUR	0,097	8
	Clase IEP	25/09/2023	EUR	0,110	9
	Clase IGC	26/06/2023	GBP	0,086	68
	Clase IGC	25/09/2023	GBP	0,099	75
	Clase IUP	26/06/2023	USD	0,093	24.550
	Clase IUP	25/09/2023	USD	0,099	27.834
	Clase NEC	26/06/2023	EUR	0,084	42.360
	Clase NEC	25/09/2023	EUR	0,091	48.286
	Clase NGC	26/06/2023	GBP	0,084	4.400.405
	Clase NGC	25/09/2023	GBP	0,096	5.042.361
Clase NUP	26/06/2023	USD	0,095	10.908	
Clase NUP	25/09/2023	USD	0,107	12.770	
					13.279.639 USD
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	Clase IEP	26/06/2023	EUR	0,054	28.915
	Clase IEP	25/09/2023	EUR	0,069	36.946
					65.861 EUR
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	Clase 1UT	24/04/2023	USD	0,030	3.258
	Clase 1UT	24/05/2023	USD	0,036	3.979
	Clase 1UT	26/06/2023	USD	0,035	3.806
	Clase 1UT	25/07/2023	USD	0,035	3.764
	Clase 1UT	24/08/2023	USD	0,033	3.626
	Clase 1UT	25/09/2023	USD	0,033	3.690
					22.123 EUR
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	Clase AEP	26/06/2023	EUR	0,038	1.723
	Clase AEP	25/09/2023	EUR	0,043	229
	Clase ASC	26/06/2023	SGD	0,042	3
	Clase ASC	25/09/2023	SGD	0,044	3
	Clase AUC	26/06/2023	USD	0,040	4
	Clase AUC	25/09/2023	USD	0,043	4

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa de la clase de acciones	Importe por Acción (en la divisa de la clase de acciones)	Importe total (en la divisa de la Cartera)
Threadneedle (Lux) - European Social Bond (continuación)	Clase IEP	26/06/2023	EUR	0,040	101.894
	Clase IEP	25/09/2023	EUR	0,045	115.613
	Clase ISC	26/06/2023	SGD	0,042	3
	Clase ISC	25/09/2023	SGD	0,044	3
	Clase IUC	26/06/2023	USD	0,041	3.000
	Clase IUC	25/09/2023	USD	0,045	3.186
	Clase NEP	26/06/2023	EUR	3,841	452.499
	Clase NEP	25/09/2023	EUR	4,504	532.765
	Clase ZEP	26/06/2023	EUR	0,039	22.668
	Clase ZEP	25/09/2023	EUR	0,045	26.069
	Clase ZGC	26/06/2023	GBP	0,040	276.148
	Clase ZGC	25/09/2023	GBP	0,046	335.302
					1.871.116 EUR
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	Clase AEP	24/04/2023	EUR	0,043	31.972
	Clase AEP	24/05/2023	EUR	0,043	29.128
	Clase AEP	26/06/2023	EUR	0,043	29.358
	Clase AEP	25/07/2023	EUR	0,043	29.650
	Clase AEP	24/08/2023	EUR	0,043	29.825
	Clase AEP	25/09/2023	EUR	0,043	30.154
	Clase DEP	24/04/2023	EUR	0,032	42.932
	Clase DEP	24/05/2023	EUR	0,032	42.450
	Clase DEP	26/06/2023	EUR	0,032	42.899
	Clase DEP	25/07/2023	EUR	0,032	42.729
	Clase DEP	24/08/2023	EUR	0,032	42.402
	Clase DEP	25/09/2023	EUR	0,032	42.063
					435.562 EUR
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	Clase AEC	24/04/2023	EUR	0,042	25.157
	Clase AEC	24/05/2023	EUR	0,042	24.695
	Clase AEC	26/06/2023	EUR	0,045	26.516
	Clase AEC	25/07/2023	EUR	0,045	27.263
	Clase AEC	24/08/2023	EUR	0,045	26.888
	Clase AEC	25/09/2023	EUR	0,041	24.042
	Clase AUP	24/04/2023	USD	0,028	19.785
	Clase AUP	24/05/2023	USD	0,028	19.969
	Clase AUP	26/06/2023	USD	0,030	21.320
	Clase AUP	25/07/2023	USD	0,030	21.190
	Clase AUP	24/08/2023	USD	0,030	21.010
	Clase AUP	25/09/2023	USD	0,028	19.440
	Clase DEC	24/04/2023	EUR	0,031	1.380
	Clase DEC	24/05/2023	EUR	0,031	1.355
	Clase DEC	26/06/2023	EUR	0,032	1.423
	Clase DEC	25/07/2023	EUR	0,032	1.438
	Clase DEC	24/08/2023	EUR	0,032	1.354
	Clase DEC	25/09/2023	EUR	0,030	1.247
	Clase IEC	24/04/2023	EUR	0,033	9.346
	Clase IEC	24/05/2023	EUR	0,033	9.180

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa de la clase de acciones	Importe por Acción (en la divisa de la clase de acciones)	Importe total (en la divisa de la Cartera)
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds (continuación)	Clase IEC	26/06/2023	EUR	0,034	10.437
	Clase IEC	25/07/2023	EUR	0,034	10.551
	Clase IEC	24/08/2023	EUR	0,034	10.329
	Clase IEC	25/09/2023	EUR	0,032	9.553
	Clase XUP	26/06/2023	USD	0,122	10
	Clase XUP	25/09/2023	USD	0,130	11
					344.889 USD
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	Clase AEC	24/04/2023	EUR	0,032	1.636
	Clase AEC	24/05/2023	EUR	0,032	1.602
	Clase AEC	26/06/2023	EUR	0,033	1.681
	Clase AEC	25/07/2023	EUR	0,033	1.701
	Clase AEC	24/08/2023	EUR	0,033	1.666
	Clase AEC	25/09/2023	EUR	0,031	1.491
	Clase AUP	24/04/2023	USD	0,041	100.516
	Clase AUP	24/05/2023	USD	0,041	99.866
	Clase AUP	26/06/2023	USD	0,043	103.488
	Clase AUP	25/07/2023	USD	0,043	102.782
	Clase AUP	24/08/2023	USD	0,043	101.531
	Clase AUP	25/09/2023	USD	0,040	93.474
	Clase SUP	24/04/2023	USD	0,039	1.632
	Clase SUP	24/05/2023	USD	0,039	1.632
	Clase SUP	26/06/2023	USD	0,041	1.716
	Clase SUP	25/07/2023	USD	0,041	1.676
	Clase SUP	24/08/2023	USD	0,041	1.628
	Clase SUP	25/09/2023	USD	0,038	1.492
	Clase XUP	26/06/2023	USD	0,121	11
	Clase XUP	25/09/2023	USD	0,127	11
					621.232 USD
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	Clase AEC	24/04/2023	EUR	0,017	50.276
	Clase AEC	24/05/2023	EUR	0,017	50.373
	Clase AEC	26/06/2023	EUR	0,018	54.783
	Clase AEC	25/07/2023	EUR	0,018	55.862
	Clase AEC	24/08/2023	EUR	0,018	55.162
	Clase AEC	25/09/2023	EUR	0,017	50.718
	Clase ASC	24/04/2023	SGD	0,024	670
	Clase ASC	24/05/2023	SGD	0,024	667
	Clase ASC	26/06/2023	SGD	0,025	701
	Clase ASC	25/07/2023	SGD	0,025	709
	Clase ASC	24/08/2023	SGD	0,025	714
	Clase ASC	25/09/2023	SGD	0,024	683
	Clase AUP	24/04/2023	USD	0,019	24.177
	Clase AUP	24/05/2023	USD	0,019	23.860
	Clase AUP	26/06/2023	USD	0,020	24.750
	Clase AUP	25/07/2023	USD	0,020	24.465
	Clase AUP	24/08/2023	USD	0,020	24.281
	Clase AUP	25/09/2023	USD	0,019	22.901

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa de la clase de acciones	Importe por Acción (en la divisa de la clase de acciones)	Importe total (en la divisa de la Cartera)
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds (continuación)	Clase XUP	24/04/2023	USD	0,034	6.287
	Clase XUP	24/05/2023	USD	0,034	6.287
	Clase XUP	26/06/2023	USD	0,036	6.656
	Clase XUP	25/07/2023	USD	0,036	6.656
	Clase XUP	24/08/2023	USD	0,036	6.656
	Clase XUP	25/09/2023	USD	0,034	6.287
					504.581 USD
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	Clase AEC	24/04/2023	EUR	0,049	740
	Clase AEC	24/05/2023	EUR	0,049	389
	Clase AEC	26/06/2023	EUR	0,051	412
	Clase AEC	25/07/2023	EUR	0,051	417
	Clase AEC	24/08/2023	EUR	0,051	408
	Clase AEC	25/09/2023	EUR	0,051	401
	Clase AUP	24/04/2023	USD	0,054	11.397
	Clase AUP	24/05/2023	USD	0,054	11.156
	Clase AUP	26/06/2023	USD	0,057	11.637
	Clase AUP	25/07/2023	USD	0,057	11.493
	Clase AUP	24/08/2023	USD	0,057	11.540
	Clase AUP	25/09/2023	USD	0,057	11.478
	Clase DEC	24/04/2023	EUR	0,037	517
	Clase DEC	24/05/2023	EUR	0,037	508
	Clase DEC	26/06/2023	EUR	0,038	531
	Clase DEC	25/07/2023	EUR	0,038	536
	Clase DEC	24/08/2023	EUR	0,038	525
	Clase DEC	25/09/2023	EUR	0,038	450
	Clase IEC	24/04/2023	EUR	0,036	4
	Clase IEC	24/05/2023	EUR	0,036	4
	Clase IEC	26/06/2023	EUR	0,038	4
	Clase IEC	25/07/2023	EUR	0,038	4
	Clase IEC	24/08/2023	EUR	0,038	4
	Clase IEC	25/09/2023	EUR	0,038	4
	Clase ISC	24/04/2023	SGD	0,040	11.974
	Clase ISC	24/05/2023	SGD	0,040	12.575
	Clase ISC	26/06/2023	SGD	0,043	14.301
	Clase ISC	25/07/2023	SGD	0,043	15.098
	Clase ISC	24/08/2023	SGD	0,043	15.140
	Clase ISC	25/09/2023	SGD	0,042	15.401
	Clase XUP	26/06/2023	USD	0,143	13
	Clase XUP	25/09/2023	USD	0,146	13
					159.074 USD
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	Clase ASC	24/04/2023	SGD	0,030	120
	Clase ASC	24/05/2023	SGD	0,030	121
	Clase ASC	26/06/2023	SGD	0,031	128
	Clase ASC	25/07/2023	SGD	0,031	132
	Clase ASC	24/08/2023	SGD	0,031	133
	Clase ASC	25/09/2023	SGD	0,032	134
	Clase AUP	24/04/2023	USD	0,031	16.782

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa de la clase de acciones	Importe por Acción (en la divisa de la clase de acciones)	Importe total (en la divisa de la Cartera)
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond <i>(continuación)</i>	Clase AUP	24/05/2023	USD	0,031	16.374
	Clase AUP	26/06/2023	USD	0,033	16.927
	Clase AUP	25/07/2023	USD	0,033	16.241
	Clase AUP	24/08/2023	USD	0,033	16.297
	Clase AUP	25/09/2023	USD	0,034	16.171
	Clase AVC	24/04/2023	AUD	0,028	2
	Clase AVC	24/05/2023	AUD	0,028	2
	Clase AVC	26/06/2023	AUD	0,030	2
	Clase AVC	25/07/2023	AUD	0,030	2
	Clase AVC	24/08/2023	AUD	0,030	2
	Clase AVC	25/09/2023	AUD	0,030	2
	Clase ZUP	24/04/2023	USD	0,030	3
	Clase ZUP	24/05/2023	USD	0,030	3
	Clase ZUP	26/06/2023	USD	0,032	3
	Clase ZUP	25/07/2023	USD	0,032	3
	Clase ZUP	24/08/2023	USD	0,032	3
Clase ZUP	25/09/2023	USD	0,033	3	
					99.590 USD
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	Clase AEC	24/04/2023	EUR	0,019	1.283
	Clase AEC	24/05/2023	EUR	0,019	1.215
	Clase AEC	26/06/2023	EUR	0,030	1.924
	Clase AEC	25/07/2023	EUR	0,030	1.943
	Clase AEC	24/08/2023	EUR	0,030	1.983
	Clase AEC	25/09/2023	EUR	0,024	1.457
	Clase AUP	24/04/2023	USD	0,024	6.661
	Clase AUP	24/05/2023	USD	0,024	6.654
	Clase AUP	26/06/2023	USD	0,036	9.658
	Clase AUP	25/07/2023	USD	0,036	9.557
	Clase AUP	24/08/2023	USD	0,036	9.527
	Clase AUP	25/09/2023	USD	0,029	7.621
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	Clase AEC	26/06/2023	EUR	0,086	394.185
	Clase AEC	25/09/2023	EUR	0,083	362.700
	Clase AEP	26/06/2023	EUR	0,110	267.356
	Clase AEP	25/09/2023	EUR	0,110	263.897
	Clase ASC	26/06/2023	SGD	0,104	1.264
	Clase ASC	25/09/2023	SGD	0,101	1.688
	Clase ASP	26/06/2023	SGD	0,104	1.453
	Clase ASP	25/09/2023	SGD	0,103	402
	Clase AUM	24/04/2023	USD	0,036	1.470
	Clase AUM	24/05/2023	USD	0,036	1.470
	Clase AUM	26/06/2023	USD	0,037	1.511
	Clase AUM	25/07/2023	USD	0,037	568
	Clase AUM	24/08/2023	USD	0,037	568
	Clase AUM	25/09/2023	USD	0,036	552
	Clase AUP	26/06/2023	USD	0,106	86.164
	Clase AUP	25/09/2023	USD	0,103	83.232

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa de la clase de acciones	Importe por Acción (en la divisa de la clase de acciones)	Importe total (en la divisa de la Cartera)
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income (continuación)	Clase DEC	26/06/2023	EUR	0,080	189.331
	Clase DEC	25/09/2023	EUR	0,078	172.836
	Clase DEP	26/06/2023	EUR	0,102	22.033
	Clase DEP	25/09/2023	EUR	0,102	21.282
	Clase DUP	26/06/2023	USD	0,095	58.988
	Clase DUP	25/09/2023	USD	0,092	54.077
	Clase ZEC	26/06/2023	EUR	0,096	10
	Clase ZEC	25/09/2023	EUR	0,093	9
	Clase ZUP	26/06/2023	USD	0,107	11
	Clase ZUP	25/09/2023	USD	0,104	10
					1.987.067 USD
Threadneedle (Lux) - Global Focus	Clase AEP	25/09/2023	EUR	0,157	746.851
	Clase AUP	25/09/2023	USD	0,114	4.163
	Clase IUP	25/09/2023	USD	0,120	6.186
	Clase ZEP	25/09/2023	EUR	0,163	663.287
					1.420.487 USD
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	Clase AEC	26/06/2023	EUR	0,115	170
	Clase AEC	25/09/2023	EUR	0,062	89
	Clase AUP	26/06/2023	USD	0,129	11
	Clase AUP	25/09/2023	USD	0,067	6
	Clase DEC	26/06/2023	EUR	0,112	9
	Clase DEC	25/09/2023	EUR	0,059	5
	Clase DUP	26/06/2023	USD	0,127	6.261
	Clase DUP	25/09/2023	USD	0,066	3.322
	Clase 1EP	26/06/2023	EUR	0,139	210.239
	Clase 1EP	25/09/2023	EUR	0,075	108.546
	Clase 1SC	26/06/2023	SGD	0,126	37.252
	Clase 1SC	25/09/2023	SGD	0,066	19.047
	Clase 1ST	24/04/2023	SGD	0,029	1.748
	Clase 1ST	24/05/2023	SGD	0,054	3.182
	Clase 1ST	26/06/2023	SGD	0,043	2.553
	Clase 1ST	25/07/2023	SGD	0,018	730
	Clase 1ST	24/08/2023	SGD	0,025	826
	Clase 1ST	25/09/2023	SGD	0,028	913
	Clase 1UP	26/06/2023	USD	0,133	50.548
	Clase 1UP	25/09/2023	USD	0,069	26.090
	Clase 1VT	24/04/2023	AUD	0,028	108
	Clase 1VT	24/05/2023	AUD	0,051	194
	Clase 1VT	26/06/2023	AUD	0,041	159
	Clase 1VT	25/07/2023	AUD	0,012	47
	Clase 1VT	24/08/2023	AUD	0,024	89
	Clase 1VT	25/09/2023	AUD	0,028	97
	Clase 2EP	26/06/2023	EUR	0,141	11
	Clase 2EP	25/09/2023	EUR	0,075	6
	Clase 2UP	26/06/2023	USD	0,135	11

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa de la clase de acciones	Importe por Acción (en la divisa de la clase de acciones)	Importe total (en la divisa de la Cartera)
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income (continuación)	Clase 2UP	25/09/2023	USD	0,070	6
	Clase 3EP	26/06/2023	EUR	0,142	1.124.222
	Clase 3EP	25/09/2023	EUR	0,076	589.541
	Clase 3UP	26/06/2023	USD	0,136	2.743
	Clase 3UP	25/09/2023	USD	0,071	1.433
	Clase 8EP	26/06/2023	EUR	0,140	36
	Clase 8EP	25/09/2023	EUR	0,075	19
	Clase 8UP	26/06/2023	USD	0,135	14.240
	Clase 8UP	25/09/2023	USD	0,071	7.489
	Clase 9EP	26/06/2023	EUR	0,142	11
	Clase 9EP	25/09/2023	EUR	0,076	6
	Clase 9UP	26/06/2023	USD	0,136	11
	Clase 9UP	25/09/2023	USD	0,071	6
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	Clase XUP	25/09/2023	USD	0,228	13
					13 USD
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	Clase AEC	25/09/2023	EUR	0,115	6
	Clase AUP	25/09/2023	USD	0,135	946
					952 USD
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	Clase AUP	25/09/2023	USD	0,127	8
	Clase IEC	25/09/2023	EUR	0,114	7
					15 USD
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	Clase AEP	25/09/2023	EUR	0,289	12.306
	Clase AUP	25/09/2023	USD	0,279	21
	Clase DEP	25/09/2023	EUR	0,282	4.958
	Clase IEP	25/09/2023	EUR	0,304	197.052
	Clase ZEP	25/09/2023	EUR	0,299	7.848
	Clase 1EP	25/09/2023	EUR	0,029	289.539
	Clase 1GP	25/09/2023	GBP	0,025	9.531
	Clase 2EP	25/09/2023	EUR	0,299	22
	Clase 2GP	25/09/2023	GBP	0,296	21
	Clase 3EP	25/09/2023	EUR	0,047	4.086
	Clase 3GP	25/09/2023	GBP	0,041	25.976
	Clase 4GP	25/09/2023	GBP	0,037	312.990
	Clase 8EP	25/09/2023	EUR	0,032	27.136
	Clase 8GP	25/09/2023	GBP	0,027	14.876
	Clase 9EP	25/09/2023	EUR	0,302	1.018
Clase 9GP	25/09/2023	GBP	0,297	90	
					907.470 EUR

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa de la clase de acciones	Importe por Acción (en la divisa de la clase de acciones)	Importe total (en la divisa de la Cartera)
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	Clase AUP	25/09/2023	USD	0,281	33.556
	Clase DUP	25/09/2023	USD	0,269	7.528
	Clase IEP	25/09/2023	EUR	0,306	350.716
	Clase XUP	25/09/2023	USD	0,301	795.557
	Clase ZGP	25/09/2023	GBP	0,273	19
	Clase ZUP	25/09/2023	USD	0,330	1.264
					1.188.640 USD
Threadneedle (Lux) - UK Equities	Clase AGP	25/09/2023	GBP	0,424	12.639
	Clase IGP	25/09/2023	GBP	0,632	132.637
	Clase NGP	25/09/2023	GBP	0,253	14
	Clase TGP	25/09/2023	GBP	0,253	14
	Clase ZGP	25/09/2023	GBP	0,227	18.641
	Clase 9EP	25/09/2023	EUR	0,204	14
					163.959 GBP
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	Clase AEC	26/06/2023	EUR	0,129	5.076
	Clase AEC	25/09/2023	EUR	0,074	2.942
	Clase ASC	26/06/2023	SGD	0,140	42
	Clase ASC	25/09/2023	SGD	0,078	24
	Clase AUC	26/06/2023	USD	0,148	11.040
	Clase AUC	25/09/2023	USD	0,082	5.226
	Clase DEC	26/06/2023	EUR	0,123	1.348
	Clase DEC	25/09/2023	EUR	0,070	775
	Clase DGP	26/06/2023	GBP	0,135	109
	Clase DGP	25/09/2023	GBP	0,079	38
	Clase IGP	26/06/2023	GBP	0,146	200.154
	Clase IGP	25/09/2023	GBP	0,088	120.061
	Clase LGP	26/06/2023	GBP	0,151	1.733.855
	Clase LGP	25/09/2023	GBP	0,087	996.287
	Clase ZGP	26/06/2023	GBP	0,155	14.395
Clase ZGP	25/09/2023	GBP	0,090	7.974	
					3.099.346 GBP
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	Clase IEP	26/06/2023	EUR	0,109	10
	Clase IEP	25/09/2023	EUR	0,135	12
	Clase LEP	26/06/2023	EUR	0,110	10
	Clase LEP	25/09/2023	EUR	0,137	12
					44 EUR

Notas a los estados financieros

(continuación)

8 COMISIONES DE RENDIMIENTO

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

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

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

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

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

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

High Water Mark del VL: con respecto a cada Clase de Acciones, es el Valor liquidativo de una Acción de dicha Clase de Acciones en la última Fecha de valoración del último año calendario pertinente en el que se pagó cualquier comisión de rendimiento acumulado. Si nunca se ha pagado una comisión de rendimiento, la High Water Mark del VL es el precio inicial de la Clase de Acciones correspondiente. La High Water Mark del VL solo se puede aumentar y no se puede reducir bajo ninguna circunstancia.

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

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

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

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

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

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

Notas a los estados financieros

(continuación)

8 COMISIONES DE RENDIMIENTO

(continuación)

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

A 30 de septiembre de 2023, no se pagaron comisiones de rendimiento.

* Consulte la nota 1.

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

A 30 de septiembre de 2023, la SICAV tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	USD	599.405	EUR	570.794	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5.427)
19/10/2023	EUR	1.674.698	USD	1.800.806	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(26.223)
19/10/2023	GBP	94.890	USD	118.542	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.710)
19/10/2023	CHF	761	USD	855	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(21)
19/10/2023	NOK	7.277	USD	681	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
19/10/2023	NOK	7.228	USD	676	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
19/10/2023	GBP	206.873	USD	258.439	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5.908)
19/10/2023	SEK	8.449.966	USD	760.691	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17.728
19/10/2023	GBP	15.102.055	USD	18.866.452	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(431.328)
19/10/2023	EUR	23.862.151	USD	25.659.005	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(373.643)
19/10/2023	EUR	9.112	USD	9.778	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(122)
19/10/2023	GBP	1.578	USD	1.971	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(45)
19/10/2023	EUR	51.880.341	USD	55.787.003	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(812.363)
19/10/2023	EUR	707	USD	760	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
19/10/2023	CHF	763	USD	858	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(21)
19/10/2023	EUR	160.037	USD	169.528	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	54
19/10/2023	GBP	893.367	USD	1.087.265	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.271
19/10/2023	USD	2.561	EUR	2.387	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	32
19/10/2023	EUR	100.311	USD	106.260	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	34
19/10/2023	EUR	7.988	USD	8.461	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
19/10/2023	EUR	343.401	USD	367.509	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.626)
19/10/2023	GBP	166.733	USD	206.789	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.259)
19/10/2023	GBP	9.680	USD	12.003	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(186)
19/10/2023	GBP	5.856	USD	7.262	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(113)
19/10/2023	EUR	91	USD	96	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	1.701.898	USD	1.801.775	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.630
19/10/2023	GBP	42.374	USD	51.696	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	30
19/10/2023	GBP	30.635	USD	37.374	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	22
19/10/2023	EUR	18.062	USD	19.122	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17
19/10/2023	EUR	60.613	USD	65.179	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(952)
19/10/2023	GBP	29.172.445	USD	36.444.082	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(833.191)
19/10/2023	GBP	374.060.276	USD	467.299.999	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10.683.499)
19/10/2023	EUR	165.818.138	USD	178.304.476	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.596.447)
19/10/2023	GBP	5.453	USD	6.812	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(156)
19/10/2023	USD	22.113	EUR	20.707	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	171
19/10/2023	USD	35.995	EUR	34.000	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(33)
19/10/2023	USD	66.851	EUR	62.466	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	659
19/10/2023	USD	61.967	EUR	58.911	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(457)
19/10/2023	USD	2.948.078	EUR	2.786.361	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.466)
19/10/2023	USD	18.222	EUR	17.222	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(28)

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	USD	8.223	EUR	7.700	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	64
19/10/2023	USD	22.006	EUR	20.624	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	152
19/10/2023	USD	642	EUR	602	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
19/10/2023	USD	7.450	EUR	6.983	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	50
19/10/2023	USD	378	EUR	354	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
19/10/2023	USD	4.611	EUR	4.322	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	32
19/10/2023	USD	9	CHF	8	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	15.626	EUR	14.769	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(24)
19/10/2023	EUR	21.053	USD	22.531	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(222)
19/10/2023	USD	275.303	EUR	262.162	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.493)
19/10/2023	USD	14.318	EUR	13.421	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	96
19/10/2023	USD	412	EUR	389	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	10	AUD	16	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	9	CHF	8	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	652.530	USD	701.667	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10.218)
19/10/2023	EUR	1.830.584	USD	1.968.430	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(28.664)
19/10/2023	SEK	7.140	USD	643	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15
19/10/2023	EUR	13.675.194	USD	14.704.955	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(214.132)
19/10/2023	EUR	13.293.414	USD	14.294.427	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(208.154)
19/10/2023	GBP	99.005.362	USD	123.683.825	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.827.682)
19/10/2023	EUR	322.113	USD	344.270	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.945)
19/10/2023	EUR	391.072	USD	417.973	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.576)
19/10/2023	EUR	22.040	USD	23.557	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(202)
19/10/2023	EUR	4.197.507	USD	4.513.586	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(65.726)
19/10/2023	USD	151.467	EUR	144.237	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.372)
19/10/2023	EUR	494	USD	529	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
19/10/2023	GBP	184.596	USD	226.444	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.107)
19/10/2023	USD	323.325	GBP	263.573	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.581
19/10/2023	USD	23.224	GBP	18.900	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	154
19/10/2023	USD	1.451.709	GBP	1.181.374	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9.600
19/10/2023	USD	5.700.151	GBP	4.683.252	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(16.707)
19/10/2023	USD	79.335	GBP	65.372	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(464)
19/10/2023	USD	335.226	GBP	270.354	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5.203
19/10/2023	USD	32.146	GBP	25.919	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	506
19/10/2023	USD	90.369	GBP	74.082	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(63)
19/10/2023	USD	66.655	GBP	54.768	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(200)
19/10/2023	USD	70.917	GBP	57.209	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.082
19/10/2023	USD	67.286	GBP	55.443	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(393)
19/10/2023	USD	72.850	GBP	58.846	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.016
19/10/2023	USD	53.645	GBP	43.332	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	748
19/10/2023	USD	19.119	GBP	15.304	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	437
19/10/2023	USD	1.438.157	GBP	1.171.124	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8.561
19/10/2023	USD	28.786	GBP	23.222	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	439
19/10/2023	USD	223.693	GBP	182.158	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.332
19/10/2023	USD	41.775	GBP	34.246	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(29)
19/10/2023	USD	37.732	GBP	30.385	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	640
19/10/2023	USD	8	EUR	7	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	25.324	EUR	24.075	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(187)

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	USD	197	EUR	187	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/10/2023	USD	356	EUR	332	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
19/10/2023	USD	1.649	EUR	1.545	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	11
19/10/2023	USD	245.261	EUR	231.808	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(372)
19/10/2023	USD	81	GBP	66	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	22.102	EUR	20.890	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(33)
19/10/2023	USD	72.641	EUR	68.656	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(110)
19/10/2023	USD	523	EUR	494	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	3.083	GBP	2.510	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	18
19/10/2023	USD	430.213	GBP	350.332	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.561
19/10/2023	USD	5.522.972	GBP	4.497.483	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	32.877
19/10/2023	USD	9.861	GBP	7.942	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	167
19/10/2023	USD	34.345	EUR	32.493	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(86)
19/10/2023	USD	85	GBP	69	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	873	EUR	814	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	11
19/10/2023	USD	7	NOK	74	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	GBP	577	USD	717	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12)
19/10/2023	USD	8.185	SEK	90.281	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(132)
19/10/2023	USD	7	SEK	78	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	7	NOK	75	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	325.717	USD	347.846	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.703)
19/10/2023	EUR	13.586	USD	14.510	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(113)
19/10/2023	EUR	14	USD	15	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	AUD	1.450	USD	932	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
19/10/2023	EUR	2.949	USD	3.117	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
04/10/2023	USD	5.129	AUD	7.928	Operaciones comerciales	JP Morgan	11
04/10/2023	GBP	750.000	USD	930.327	Operaciones comerciales	JP Morgan	(14.890)
04/10/2023	CAD	140.135	USD	103.845	Operaciones comerciales	JP Morgan	(188)
04/10/2023	USD	112.337	CAD	152.736	Operaciones comerciales	JP Morgan	(641)
04/10/2023	EUR	1.082.980	USD	1.151.413	Operaciones comerciales	Barclays	(4.592)
04/10/2023	AUD	9.906	USD	6.359	Operaciones comerciales	JP Morgan	35
04/10/2023	EUR	840.000	USD	886.053	Operaciones comerciales	JP Morgan	3.464
04/10/2023	CAD	274.281	USD	200.988	Operaciones comerciales	Barclays	1.896
04/10/2023	CAD	308.386	USD	229.410	Operaciones comerciales	JP Morgan	(1.298)
04/10/2023	USD	14.923.070	CAD	20.222.767	Operaciones comerciales	JP Morgan	(35.587)
04/10/2023	USD	5.452	AUD	8.469	Operaciones comerciales	JP Morgan	(15)
04/10/2023	USD	74.501	CAD	100.409	Operaciones comerciales	JP Morgan	229
04/10/2023	AUD	7.703	USD	4.928	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	45
04/10/2023	USD	400.161	EUR	375.000	Operaciones comerciales	Barclays	3.055
04/10/2023	USD	2.857.246	EUR	2.680.670	Operaciones comerciales	JP Morgan	18.550
04/10/2023	USD	383.185	EUR	357.000	Operaciones comerciales	JP Morgan	5.139
04/10/2023	USD	3.158.582	EUR	2.951.450	Operaciones comerciales	JP Morgan	33.140
04/10/2023	USD	265.032.731	EUR	243.560.330	Operaciones comerciales	JP Morgan	7.113.425
04/10/2023	USD	4.864.610	EUR	4.500.000	Operaciones comerciales	Barclays	99.321
04/10/2023	CAD	233.112	USD	172.882	Operaciones comerciales	JP Morgan	(450)
04/10/2023	JPY	2.535.423	USD	17.039	Operaciones comerciales	JP Morgan	(36)
04/10/2023	CAD	120.897	USD	89.474	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(47)
04/10/2023	USD	2.702	AUD	4.235	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(32)

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
04/10/2023	USD	4.332	AUD	6.712	Operaciones comerciales	JP Morgan	(1)
04/10/2023	USD	600.016	AUD	923.863	Operaciones comerciales	JP Morgan	3.656
04/10/2023	USD	2.706.871	JPY	391.041.218	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	84.376
04/10/2023	EUR	1.364.065	USD	1.434.471	Operaciones comerciales	JP Morgan	10.004
04/10/2023	EUR	1.640.430	USD	1.761.666	Operaciones comerciales	Barclays	(24.534)
04/10/2023	EUR	1.268.950	USD	1.361.849	Operaciones comerciales	Barclays	(18.096)
04/10/2023	AUD	13.353	USD	8.599	Operaciones comerciales	JP Morgan	20
04/10/2023	CAD	203.457	USD	151.161	Operaciones comerciales	JP Morgan	(665)
04/10/2023	AUD	11.872	USD	7.647	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	17
04/10/2023	EUR	450.000	USD	480.215	Operaciones comerciales	JP Morgan	(3.688)
04/10/2023	GBP	488.030	USD	599.206	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(3.524)
04/10/2023	AUD	17.309	USD	11.055	Operaciones comerciales	JP Morgan	119
04/10/2023	AUD	6.228	USD	3.991	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	29
04/10/2023	GBP	850.410	USD	1.060.080	Operaciones comerciales	Barclays	(22.084)
04/10/2023	CAD	5.428.310	USD	4.023.662	Operaciones comerciales	Barclays	(8.374)
04/10/2023	USD	5.227	AUD	8.080	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	11
04/10/2023	GBP	5.112.790	USD	6.331.126	Operaciones comerciales	Barclays	(90.541)
04/10/2023	AUD	17.591	USD	11.225	Operaciones comerciales	JP Morgan	130
04/10/2023	GBP	210.000	USD	255.107	Operaciones comerciales	JP Morgan	1.215
04/10/2023	AUD	60.000	USD	38.287	Operaciones comerciales	JP Morgan	444
04/10/2023	CAD	200.000	USD	147.999	Operaciones comerciales	JP Morgan	(60)
04/10/2023	USD	13.466	JPY	1.976.390	Operaciones comerciales	JP Morgan	211
04/10/2023	USD	694.509	GBP	558.323	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	13.029
04/10/2023	USD	31.515	JPY	4.609.218	Operaciones comerciales	JP Morgan	604
04/10/2023	USD	101.080.643	GBP	79.726.505	Operaciones comerciales	JP Morgan	3.767.724
04/10/2023	USD	28.069	JPY	4.157.056	Operaciones comerciales	JP Morgan	190
04/10/2023	USD	3.681.895	GBP	3.022.380	Operaciones comerciales	JP Morgan	(7.170)
04/10/2023	AUD	17.811	USD	11.494	Operaciones comerciales	JP Morgan	3
04/10/2023	USD	3.600	AUD	5.614	Operaciones comerciales	JP Morgan	(24)
04/10/2023	JPY	3.415.889	USD	23.404	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(496)
04/10/2023	EUR	1.950.000	USD	2.082.338	Operaciones comerciales	JP Morgan	(17.388)
							(8.175.655) USD

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	USD	937	EUR	872	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
19/10/2023	CHF	1.512.981	EUR	1.580.990	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(16.795)
19/10/2023	CHF	805	EUR	842	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
19/10/2023	EUR	9	NOK	103	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	NOK	7.630	EUR	664	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
19/10/2023	GBP	666	EUR	774	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
19/10/2023	EUR	9	USD	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	10	GBP	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	NOK	7.701	EUR	670	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	14

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	EUR	9	CHF	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	9	NOK	103	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	16.497	CHF	15.910	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	49
04/10/2023	USD	1.150.000	EUR	1.092.486	Operaciones comerciales	Lloyds	(6.504)
04/10/2023	GBP	316.580	EUR	367.040	Operaciones comerciales	NatWest Markets	(2.139)
04/10/2023	EUR	19.224	GBP	16.453	Operaciones comerciales	NatWest Markets	260
04/10/2023	EUR	116.662	USD	125.000	Operaciones comerciales	NatWest Markets	(1.380)
04/10/2023	EUR	16.599	GBP	14.380	Operaciones comerciales	JP Morgan	24
04/10/2023	EUR	472.897	USD	505.000	Operaciones comerciales	JP Morgan	(3.992)
04/10/2023	EUR	8.253.305	USD	8.977.211	Operaciones comerciales	NatWest Markets	(224.210)
04/10/2023	EUR	3.285.260	GBP	2.817.731	Operaciones comerciales	Lloyds	37.447
04/10/2023	EUR	272.979	GBP	234.000	Operaciones comerciales	NatWest Markets	3.263
04/10/2023	USD	468.420	EUR	432.599	Operaciones comerciales	JP Morgan	9.745
							(204.208) EUR

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	CHF	846	EUR	884	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
19/10/2023	EUR	314.396	CHF	300.261	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.967
19/10/2023	CHF	2.610	EUR	2.736	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(38)
19/10/2023	CHF	327.447	EUR	342.166	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.635)
19/10/2023	CHF	54.970	EUR	57.441	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(610)
19/10/2023	CHF	283.389	EUR	296.127	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.146)
19/10/2023	CHF	840	EUR	878	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
19/10/2023	NOK	8.124	EUR	707	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	14
19/10/2023	NOK	8.015	EUR	697	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	14
19/10/2023	SEK	8.001	EUR	670	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	26
19/10/2023	SEK	7.866	EUR	659	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	25
19/10/2023	USD	1.087.872	EUR	1.011.690	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	14.950
19/10/2023	CHF	790	EUR	826	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
05/10/2023	GBP	227.360	EUR	264.909	Operaciones comerciales	Barclays	(2.856)
05/10/2023	GBP	1.630.480	EUR	1.887.634	Operaciones comerciales	Lloyds	(8.361)
05/10/2023	EUR	174.276	GBP	150.988	Operaciones comerciales	JP Morgan	249
05/10/2023	EUR	50.617.733	GBP	43.307.520	Operaciones comerciales	NatWest Markets	702.103
05/10/2023	EUR	632.334	GBP	550.000	Operaciones comerciales	NatWest Markets	(1.591)
05/10/2023	EUR	341.195	GBP	295.270	Operaciones comerciales	JP Morgan	870
05/10/2023	EUR	201.214	GBP	175.000	Operaciones comerciales	NatWest Markets	(489)
05/10/2023	EUR	277.156	GBP	237.158	Operaciones comerciales	JP Morgan	3.810
05/10/2023	EUR	3.570.019	USD	3.841.766	Operaciones comerciales	Lloyds	(57.728)
05/10/2023	EUR	1.317.593	GBP	1.142.340	Operaciones comerciales	NatWest Markets	945
05/10/2023	EUR	16.248	USD	17.462	Operaciones comerciales	JP Morgan	(241)
05/10/2023	EUR	9.813	USD	10.501	Operaciones comerciales	JP Morgan	(103)
							648.148 EUR

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	NOK	8.788	EUR	764	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15
19/10/2023	GBP	8	EUR	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	SEK	8.734	EUR	731	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	28
19/10/2023	NOK	8.868	EUR	771	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	16
19/10/2023	GBP	4.959.700	EUR	5.761.969	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(48.419)
19/10/2023	SEK	8.587	EUR	719	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	28
19/10/2023	GBP	13.633.323	EUR	15.838.616	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(133.096)
19/10/2023	GBP	771	EUR	895	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8)
19/10/2023	GBP	765	EUR	889	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
19/10/2023	EUR	1.086.379	GBP	940.143	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.341
05/10/2023	EUR	38.993	GBP	33.365	Operaciones comerciales	JP Morgan	536
05/10/2023	EUR	27.059	GBP	23.412	Operaciones comerciales	Barclays	75
05/10/2023	GBP	190.040	EUR	220.949	Operaciones comerciales	JP Morgan	(1.911)
05/10/2023	GBP	207.410	EUR	241.661	Operaciones comerciales	Barclays	(2.603)
05/10/2023	EUR	10.743.270	GBP	9.191.840	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	148.888
05/10/2023	EUR	28.252	GBP	24.574	Operaciones comerciales	JP Morgan	(73)
05/10/2023	EUR	36.992	GBP	31.796	Operaciones comerciales	JP Morgan	345
05/10/2023	EUR	1.045	USD	1.123	Operaciones comerciales	JP Morgan	(16)
05/10/2023	EUR	295.185	USD	317.617	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(4.738)
							(37.599) EUR

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - European Social Bond tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	GBP	123.808	EUR	142.672	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(46)
19/10/2023	EUR	620	GBP	537	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/10/2023	GBP	5.883	EUR	6.835	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(57)
19/10/2023	EUR	3.244	GBP	2.823	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
19/10/2023	EUR	7.052	GBP	6.124	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
19/10/2023	EUR	8.308	GBP	7.145	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	77
19/10/2023	EUR	32.268	GBP	27.925	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	99
19/10/2023	EUR	1.826	GBP	1.588	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
19/10/2023	USD	912	EUR	848	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
19/10/2023	GBP	55.357.695	EUR	64.312.220	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(540.432)
19/10/2023	NOK	7.541	EUR	656	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
19/10/2023	SEK	7.411	EUR	620	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	24
19/10/2023	GBP	300.812	EUR	347.165	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(632)
19/10/2023	GBP	5.026	EUR	5.774	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	16
19/10/2023	GBP	6.224	EUR	7.181	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
19/10/2023	GBP	307	EUR	354	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/10/2023	GBP	123.611	EUR	143.483	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.083)
19/10/2023	EUR	7.759	USD	8.221	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	11	USD	12	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	11	USD	11	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	11	USD	12	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	EUR	7	SGD	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	7	SGD	11	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	6	SGD	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	7	SGD	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	GBP	23.511	EUR	27.077	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
19/10/2023	GBP	1.162.202	EUR	1.351.424	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12.573)
19/10/2023	GBP	7.450	EUR	8.655	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(73)
19/10/2023	EUR	737.231	GBP	638.209	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.018
19/10/2023	EUR	1.639	GBP	1.414	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
19/10/2023	EUR	3.345	GBP	2.881	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	25
19/10/2023	EUR	7	NOK	80	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	GBP	11.364	EUR	13.095	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
19/10/2023	GBP	641	EUR	745	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
19/10/2023	SGD	854	EUR	584	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
19/10/2023	SGD	883	EUR	604	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
19/10/2023	USD	651.143	EUR	605.545	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8.948
19/10/2023	USD	896	EUR	833	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12
19/10/2023	SGD	852	EUR	583	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
19/10/2023	SGD	880	EUR	602	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
19/10/2023	GBP	763	EUR	877	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
19/10/2023	CHF	48.448	EUR	50.249	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(161)
19/10/2023	USD	862	EUR	801	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12
19/10/2023	USD	894	EUR	832	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12
19/10/2023	CHF	322.437	EUR	336.930	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.579)
19/10/2023	EUR	7	NOK	81	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	CHF	30.854	EUR	32.240	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(343)
19/10/2023	GBP	7.262.266	EUR	8.436.992	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(70.898)
19/10/2023	SEK	7.399	EUR	619	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	24
19/10/2023	EUR	8	SEK	87	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	7	SEK	86	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	3.983	CHF	3.842	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
19/10/2023	EUR	261.292	CHF	252.447	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	299
19/10/2023	EUR	345	CHF	333	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	CHF	23.617.370	EUR	24.678.991	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(262.173)
19/10/2023	EUR	3.674	CHF	3.549	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
19/10/2023	EUR	76.948	CHF	74.421	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
19/10/2023	EUR	66.671	CHF	63.878	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	630
19/10/2023	NOK	7.536	EUR	656	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
19/10/2023	GBP	872	EUR	1.010	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
18/10/2023	EUR	71.151	USD	75.488	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(92)
18/10/2023	EUR	417.789	GBP	358.721	Operaciones comerciales	HSBC	4.533
18/10/2023	EUR	47.150.677	GBP	40.524.107	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	465.724
18/10/2023	EUR	239.273	GBP	208.316	Operaciones comerciales	HSBC	(715)
18/10/2023	EUR	441.896	SEK	5.264.470	Operaciones comerciales	HSBC	(15.778)
18/10/2023	EUR	727.255	CAD	1.052.349	Operaciones comerciales	HSBC	(7.533)
18/10/2023	EUR	13.864.265	USD	14.841.777	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(142.850)
							(576.496) EUR

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
22/11/2023	EUR	231.411	GBP	199.996	Operaciones comerciales	NatWest Markets	1.323
22/11/2023	EUR	105.994	AUD	175.664	Operaciones comerciales	NatWest Markets	(1.040)
22/11/2023	EUR	13.924.748	USD	14.897.837	Operaciones comerciales	NatWest Markets	(113.739)
22/11/2023	JPY	39.056.185	EUR	249.792	Operaciones comerciales	HSBC	(933)
22/11/2023	EUR	17.485.612	GBP	15.095.346	Operaciones comerciales	NatWest Markets	119.020
22/11/2023	EUR	90.048	USD	96.355	Operaciones comerciales	HSBC	(749)
19/10/2023	NOK	7.911	EUR	688	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	14
19/10/2023	NOK	8.010	EUR	697	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	14
19/10/2023	SEK	7.718	EUR	646	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	25
19/10/2023	USD	20.928	EUR	19.463	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	288
19/10/2023	USD	923	EUR	858	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
							4.236 EUR

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	USD	21.942	EUR	20.860	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(162)
19/10/2023	USD	897	EUR	846	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	134.703	EUR	125.867	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.328
19/10/2023	USD	22.808	EUR	21.556	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(35)
19/10/2023	USD	619	EUR	576	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
19/10/2023	USD	60.048	EUR	56.671	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
19/10/2023	USD	4.671	EUR	4.370	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	40
19/10/2023	USD	7.325	EUR	6.853	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	63
19/10/2023	USD	659	EUR	618	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
19/10/2023	USD	2.120	EUR	1.986	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15
19/10/2023	USD	17.083	EUR	15.996	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	133
19/10/2023	USD	19.195	EUR	18.167	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(55)
19/10/2023	USD	18.885	EUR	17.953	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(139)
19/10/2023	USD	513	EUR	487	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
19/10/2023	USD	3.103	EUR	2.929	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	16.373	EUR	15.456	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
19/10/2023	EUR	97	USD	103	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/10/2023	EUR	11.177.976	USD	12.019.693	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(175.030)
19/10/2023	SGD	102.768	USD	75.620	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(259)
19/10/2023	NOK	7.436	USD	696	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
19/10/2023	EUR	15.844	USD	16.747	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	42
19/10/2023	EUR	4.486.954	USD	4.824.828	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(70.259)
19/10/2023	EUR	1.971.751	USD	2.120.227	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(30.874)
19/10/2023	EUR	5.502.770	USD	5.917.136	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(86.165)
19/10/2023	EUR	138.900	USD	149.359	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.175)
19/10/2023	EUR	281.245	USD	302.424	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.404)
19/10/2023	SEK	7.360	USD	663	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15
19/10/2023	EUR	322	USD	344	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	EUR	2.155.674	USD	2.317.999	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(33.754)
19/10/2023	EUR	1.098	USD	1.174	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10)
19/10/2023	EUR	2.939	USD	3.154	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(39)
19/10/2023	EUR	149.780	USD	159.956	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.243)
19/10/2023	USD	1.063	EUR	996	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
							(402.958) USD

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	SEK	6.916	USD	623	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15
19/10/2023	USD	7	SEK	81	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	10	SEK	111	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	8	NOK	82	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	4.146	EUR	3.919	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
19/10/2023	USD	2.744	EUR	2.613	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(25)
19/10/2023	USD	3.713	EUR	3.536	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(34)
19/10/2023	USD	6.943	EUR	6.612	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(63)
19/10/2023	USD	5.356	EUR	5.021	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	36
19/10/2023	USD	3.075	EUR	2.882	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	20
19/10/2023	SGD	25.770	USD	18.962	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(65)
19/10/2023	USD	300	SGD	409	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	223	SGD	306	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/10/2023	EUR	6.988	USD	7.498	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(94)
19/10/2023	EUR	313.749	USD	337.375	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.913)
19/10/2023	EUR	221.188	USD	237.844	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.463)
19/10/2023	EUR	296.934	USD	319.294	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.650)
19/10/2023	EUR	547.448	USD	588.672	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8.573)
19/10/2023	EUR	97	USD	102	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	5.100	EUR	4.781	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	34
19/10/2023	USD	9.462	EUR	8.870	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	63
19/10/2023	USD	10	NOK	109	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	7.454	EUR	6.947	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	93
19/10/2023	NOK	7.043	USD	659	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
18/10/2023	USD	497.099	MXN	8.585.790	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	4.668
18/10/2023	USD	941.972	EUR	861.335	Operaciones comerciales	NatWest Markets	29.280
							12.326 USD

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	SGD	15	USD	11	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	54.011	EUR	50.618	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	374
19/10/2023	USD	131.148	EUR	122.909	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	908
19/10/2023	USD	1	EUR	1	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	621	EUR	587	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/10/2023	USD	6.393	EUR	5.945	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	93
19/10/2023	USD	57	EUR	54	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/10/2023	USD	26.506	EUR	25.199	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(196)
19/10/2023	USD	13.049	EUR	12.405	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(96)
19/10/2023	USD	28	EUR	27	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	7	NOK	76	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	1.714	SGD	2.351	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
19/10/2023	EUR	78.343	USD	84.243	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.227)
19/10/2023	EUR	99.990	USD	107.293	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.339)
19/10/2023	USD	18.903	EUR	17.616	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	236
19/10/2023	EUR	827.343	USD	889.643	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12.955)
19/10/2023	SGD	911	USD	667	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/10/2023	SGD	198	USD	146	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	SGD	398	USD	292	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/10/2023	SGD	86	USD	63	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	SGD	136.833	USD	100.687	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(344)
19/10/2023	EUR	2.736.688	USD	2.942.764	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(42.852)
19/10/2023	EUR	8.786.459	USD	9.448.092	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(137.582)
19/10/2023	EUR	74	USD	79	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	11.549.624	USD	12.419.327	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(180.848)
19/10/2023	NOK	77	USD	7	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	NOK	7.516	USD	703	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
19/10/2023	SEK	7.432	USD	669	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	16
19/10/2023	SGD	223.955	USD	164.793	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(564)
19/10/2023	SGD	205	USD	150	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	412	EUR	385	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
18/10/2023	USD	1.061.455	EUR	970.589	Operaciones comerciales	NatWest Markets	32.995
							(343.382) USD

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	SGD	16.478	USD	12.064	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	20
19/10/2023	USD	620	EUR	586	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/10/2023	USD	10	EUR	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	7	NOK	81	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	130.997	EUR	123.736	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(118)
19/10/2023	USD	7.946	EUR	7.505	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	USD	7	SGD	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	SGD	2.097	USD	1.541	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
19/10/2023	EUR	336	USD	359	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
19/10/2023	EUR	74.978	USD	80.624	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.174)
19/10/2023	USD	7	SEK	82	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	97.422	USD	104.758	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.525)
19/10/2023	SEK	7.979	USD	718	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17
19/10/2023	CHF	839	USD	943	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(24)
19/10/2023	NOK	7.891	USD	738	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
19/10/2023	NOK	8.103	USD	758	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
19/10/2023	GBP	687	USD	858	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20)
19/10/2023	EUR	56.636	USD	60.901	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(887)
19/10/2023	EUR	698	USD	751	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
19/10/2023	EUR	540.520	USD	581.222	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8.465)
19/10/2023	EUR	348.000	USD	374.205	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5.449)
19/10/2023	SEK	7.754	USD	698	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	16
19/10/2023	USD	1.440	EUR	1.361	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
19/10/2023	USD	1.160	EUR	1.096	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
19/10/2023	USD	193	EUR	183	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	SGD	17.139	USD	12.584	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(15)
19/10/2023	SGD	4.124.542	USD	3.034.975	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10.379)
19/10/2023	SGD	22.153	USD	16.301	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(56)
19/10/2023	SGD	270	USD	198	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	SGD	10.491	USD	7.708	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14)
19/10/2023	SGD	5.415	USD	3.952	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19
19/10/2023	SGD	3.444	USD	2.527	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
19/10/2023	SGD	6.855	USD	5.017	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
19/10/2023	SGD	181	USD	133	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	SGD	32.885	USD	24.130	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(15)
19/10/2023	SGD	14.449	USD	10.580	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15
19/10/2023	SGD	504.145	USD	370.967	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.269)
19/10/2023	USD	1.744	EUR	1.632	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15
19/10/2023	USD	3.100	SGD	4.215	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
19/10/2023	USD	13.168	EUR	12.341	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	91
19/10/2023	USD	57	SGD	78	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	641.187	EUR	606.015	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(971)
19/10/2023	USD	4.689	EUR	4.465	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(42)
19/10/2023	USD	11	CHF	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	10	GBP	8	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	32.572	SGD	44.588	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(125)
19/10/2023	EUR	58.554.121	USD	62.963.328	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(916.865)
19/10/2023	EUR	31	USD	33	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
							(947.223) USD

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	AUD	997	USD	641	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
19/10/2023	USD	7	AUD	11	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	36.113	EUR	34.166	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(91)
19/10/2023	USD	896.518	EUR	835.495	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	11.182
19/10/2023	USD	8.613	EUR	8.010	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	126
19/10/2023	USD	989	EUR	927	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
19/10/2023	USD	1.259	SGD	1.713	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
19/10/2023	USD	6.938	EUR	6.497	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	54
19/10/2023	USD	236	EUR	224	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
19/10/2023	USD	10.347	EUR	9.707	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	61
19/10/2023	USD	8	GBP	6	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	3.785	SGD	5.154	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
19/10/2023	USD	493	SGD	671	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/10/2023	USD	149.658	EUR	141.241	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8)
19/10/2023	USD	9	SGD	12	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	7	AUD	11	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	6.286	EUR	5.897	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	37
19/10/2023	USD	7	SEK	79	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	867	EUR	813	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
19/10/2023	USD	8	SGD	11	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	SGD	265	USD	194	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	SGD	62	USD	46	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	SGD	1.172	USD	862	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
19/10/2023	AUD	809	USD	520	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
19/10/2023	EUR	881.571	USD	947.955	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13.804)
19/10/2023	EUR	974	USD	1.041	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
19/10/2023	EUR	528.855	USD	568.678	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8.281)
19/10/2023	EUR	13.786.438	USD	14.824.576	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(215.873)
19/10/2023	GBP	627	USD	784	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(18)
19/10/2023	SEK	7.191	USD	647	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15
19/10/2023	SGD	762	USD	558	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/10/2023	SGD	5	USD	3	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	SGD	474	USD	348	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	SGD	313	USD	230	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/10/2023	SGD	1.000	USD	736	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
19/10/2023	SGD	228	USD	168	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	SGD	245	USD	179	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	SGD	505	USD	371	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/10/2023	SGD	462.752	USD	340.508	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.164)
19/10/2023	SGD	114	USD	83	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	SGD	411	USD	300	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/10/2023	SGD	49.567	USD	36.473	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(125)
19/10/2023	USD	7	SGD	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	1.274	EUR	1.203	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
							(227.880) USD

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
17/11/2023	EUR	240.000	USD	262.669	Operaciones comerciales	Lloyds	(8.030)
17/11/2023	GBP	670.000	USD	854.317	Operaciones comerciales	Barclays	(36.318)
17/11/2023	JPY	155.000.000	USD	1.076.504	Operaciones comerciales	Lloyds	(29.175)
17/11/2023	GBP	400.000	USD	499.094	Operaciones comerciales	Barclays	(10.736)
19/10/2023	USD	2.725	EUR	2.591	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20)
19/10/2023	USD	2.948	EUR	2.764	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	20
19/10/2023	SEK	7.243	USD	652	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15
19/10/2023	GBP	640	USD	800	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(18)
19/10/2023	EUR	108.473	USD	116.641	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.699)
19/10/2023	EUR	660.963	USD	710.735	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10.350)
19/10/2023	EUR	1.389.977	USD	1.494.644	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(21.765)
19/10/2023	EUR	30	USD	31	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	17	SEK	195	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	18	GBP	14	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	47.918	EUR	44.921	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	318
19/10/2023	USD	192.143	EUR	180.124	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.275
19/10/2023	USD	572	EUR	536	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
19/10/2023	EUR	145	USD	154	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	6.823.116	USD	7.336.907	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(106.838)
19/10/2023	USD	17.185	EUR	16.243	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(27)
							(223.344) USD

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
22/11/2023	THB	564.597	USD	15.832	Operaciones comerciales	HSBC	(252)
22/11/2023	EUR	146.353	USD	156.580	Operaciones comerciales	NatWest Markets	(1.266)
22/11/2023	MXN	491.559	USD	28.503	Operaciones comerciales	HSBC	(480)
22/11/2023	JPY	69.607.982	USD	476.300	Operaciones comerciales	NatWest Markets	(5.611)
22/11/2023	NOK	48.675	USD	4.494	Operaciones comerciales	NatWest Markets	87
22/11/2023	CHF	24.402	USD	27.409	Operaciones comerciales	NatWest Markets	(575)
22/11/2023	USD	3.697	GBP	2.986	Operaciones comerciales	JP Morgan	51
22/11/2023	USD	2.223	JPY	325.863	Operaciones comerciales	HSBC	19
22/11/2023	PLN	5.827	USD	1.338	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(5)
22/11/2023	USD	3.353	CAD	4.524	Operaciones comerciales	NatWest Markets	4
22/11/2023	SEK	204.432	USD	18.283	Operaciones comerciales	Barclays	577
22/11/2023	NZD	14.125	USD	8.349	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	138
22/11/2023	AUD	43.018	USD	27.759	Operaciones comerciales	HSBC	58
22/11/2023	SGD	16.213	USD	11.936	Operaciones comerciales	HSBC	(28)
22/11/2023	KRW	106.578.746	USD	80.586	Operaciones comerciales	UBS	(1.168)
22/11/2023	IDR	358.335.204	USD	23.276	Operaciones comerciales	HSBC	(145)
22/11/2023	CNY	229.535	USD	31.845	Operaciones comerciales	HSBC	(274)
22/11/2023	USD	393.003	GBP	317.155	Operaciones comerciales	Barclays	5.779
22/11/2023	PLN	128.422	USD	29.465	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(87)

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
17/11/2023	USD	6.490.704	GBP	5.100.000	Operaciones comerciales	Lloyds	264.065
17/11/2023	EUR	3.400.000	USD	3.717.635	Operaciones comerciales	NatWest Markets	(110.242)
19/10/2023	USD	16.763	EUR	15.824	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
19/10/2023	EUR	299	USD	319	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
19/10/2023	USD	18	EUR	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	SGD	187.612	USD	138.051	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(472)
19/10/2023	USD	39.082	EUR	37.155	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(288)
19/10/2023	USD	5.230	EUR	4.972	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(39)
19/10/2023	USD	5.081	EUR	4.799	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
19/10/2023	USD	5.148	EUR	4.863	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
19/10/2023	USD	7.038	EUR	6.648	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
19/10/2023	USD	209	EUR	198	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	2.040	USD	2.156	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
19/10/2023	USD	3.102	SGD	4.247	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12)
19/10/2023	EUR	540.591	USD	581.298	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8.465)
19/10/2023	CHF	834	USD	937	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(23)
19/10/2023	USD	17.963	EUR	16.838	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	120
19/10/2023	EUR	27.475.778	USD	29.544.742	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(430.226)
19/10/2023	EUR	13.101.510	USD	14.088.072	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(205.149)
19/10/2023	EUR	695	USD	748	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
19/10/2023	EUR	2.140.608	USD	2.301.799	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(33.519)
19/10/2023	EUR	99.749	USD	107.035	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.336)
19/10/2023	EUR	50	USD	53	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	SGD	1.877	USD	1.374	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
19/10/2023	EUR	9.296.919	USD	9.996.990	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(145.575)
19/10/2023	EUR	3.900	USD	4.129	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
19/10/2023	SGD	105	USD	77	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	17.449	EUR	16.340	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	135
19/10/2023	SGD	6.735	USD	4.956	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17)
19/10/2023	USD	357.528	EUR	337.916	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(542)
19/10/2023	USD	3.123	SGD	4.263	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
19/10/2023	USD	21	CHF	19	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	46.255	EUR	43.719	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(72)
19/10/2023	USD	13.932	EUR	13.152	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
19/10/2023	USD	3.021	EUR	2.827	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	26
19/10/2023	USD	4.561	EUR	4.274	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	32
19/10/2023	USD	10.326	EUR	9.677	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	71
19/10/2023	USD	747.766	EUR	700.194	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5.806
19/10/2023	USD	187.941	EUR	178.969	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.702)
19/10/2023	USD	4.419	EUR	4.134	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	38
19/10/2023	USD	5.672	EUR	5.366	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14)
19/10/2023	USD	4.662	EUR	4.410	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12)
19/10/2023	USD	8.609	EUR	8.070	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	58
19/10/2023	USD	728.179	EUR	688.234	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.103)
19/10/2023	USD	531	EUR	496	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
19/10/2023	USD	18.801	EUR	17.521	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	235
19/10/2023	USD	5.030	EUR	4.688	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	63

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	USD	2.155	EUR	2.020	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	14
19/10/2023	USD	12.667	EUR	11.875	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	84
19/10/2023	USD	103	SGD	140	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
05/10/2023	EUR	62.646	USD	66.716	Operaciones comerciales	Lloyds	(373)
05/10/2023	EUR	72.631	USD	76.708	Operaciones comerciales	JP Morgan	208
05/10/2023	EUR	62.363	USD	66.155	Operaciones comerciales	JP Morgan	(113)
05/10/2023	USD	4.012.988	GBP	3.190.570	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	118.603
05/10/2023	USD	14.028	GBP	11.165	Operaciones comerciales	UBS	400
05/10/2023	EUR	400.000	USD	423.770	Operaciones comerciales	NatWest Markets	(171)
05/10/2023	USD	83.681	EUR	77.839	Operaciones comerciales	JP Morgan	1.250
05/10/2023	USD	104.881	GBP	86.020	Operaciones comerciales	UBS	(115)
05/10/2023	USD	67.913	EUR	63.647	Operaciones comerciales	NatWest Markets	511
05/10/2023	USD	21.179.649	EUR	19.689.496	Operaciones comerciales	Barclays	328.414
05/10/2023	USD	14.862	GBP	12.006	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	207
05/10/2023	USD	12.437	GBP	9.972	Operaciones comerciales	Lloyds	265
05/10/2023	USD	53.014	EUR	49.349	Operaciones comerciales	Lloyds	754
05/10/2023	EUR	300.000	USD	322.302	Operaciones comerciales	UBS	(4.603)
05/10/2023	USD	12.387	GBP	10.068	Operaciones comerciales	UBS	98
05/10/2023	USD	91.550	GBP	75.000	Operaciones comerciales	HSBC	6
04/10/2023	AUD	71	USD	45	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	0
04/10/2023	AUD	112	USD	72	Operaciones comerciales	JP Morgan	0
04/10/2023	AUD	87	USD	56	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	1
04/10/2023	CAD	3.314	USD	2.429	Operaciones comerciales	Barclays	23
04/10/2023	JPY	6.723	USD	46	Operaciones comerciales	JP Morgan	(1)
04/10/2023	CAD	682	USD	502	Operaciones comerciales	NatWest Markets	2
04/10/2023	USD	44.607	GBP	35.780	Operaciones comerciales	Lloyds	935
04/10/2023	USD	859	CAD	1.168	Operaciones comerciales	JP Morgan	(5)
04/10/2023	USD	176	AUD	271	Operaciones comerciales	JP Morgan	0
04/10/2023	JPY	3.854	USD	26	Operaciones comerciales	JP Morgan	0
04/10/2023	USD	866	CAD	1.167	Operaciones comerciales	JP Morgan	3
04/10/2023	USD	67	AUD	104	Operaciones comerciales	JP Morgan	0
04/10/2023	USD	49	AUD	75	Operaciones comerciales	JP Morgan	0
04/10/2023	USD	26	JPY	3.889	Operaciones comerciales	HSBC	0
04/10/2023	USD	79.937	EUR	75.000	Operaciones comerciales	Barclays	516
04/10/2023	USD	9.139	GBP	7.428	Operaciones comerciales	UBS	73
04/10/2023	AUD	151	USD	97	Operaciones comerciales	JP Morgan	0
04/10/2023	CAD	1.242	USD	919	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	0
04/10/2023	CAD	2.902	USD	2.158	Operaciones comerciales	JP Morgan	(12)
04/10/2023	CAD	2.574	USD	1.912	Operaciones comerciales	JP Morgan	(8)
04/10/2023	USD	59	AUD	91	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	0
04/10/2023	GBP	75.940	USD	94.047	Operaciones comerciales	Barclays	(1.355)
04/10/2023	AUD	196	USD	125	Operaciones comerciales	JP Morgan	1
04/10/2023	USD	2.122	CAD	2.876	Operaciones comerciales	JP Morgan	(6)
04/10/2023	USD	7.474	AUD	11.508	Operaciones comerciales	Lloyds	46
04/10/2023	USD	40	AUD	63	Operaciones comerciales	JP Morgan	0
04/10/2023	USD	12.976	GBP	10.384	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	302
04/10/2023	USD	3.510.278	EUR	3.227.125	Operaciones comerciales	JP Morgan	92.900

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
04/10/2023	CAD	465	USD	345	Operaciones comerciales	JP Morgan	(2)
04/10/2023	AUD	202	USD	130	Operaciones comerciales	JP Morgan	0
04/10/2023	AUD	134	USD	86	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	0
04/10/2023	CAD	2.971	USD	2.175	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	23
04/10/2023	EUR	175.000	USD	186.955	Operaciones comerciales	Barclays	(1.639)
04/10/2023	USD	1.331.489	GBP	1.050.200	Operaciones comerciales	JP Morgan	49.631
04/10/2023	USD	71.631	CAD	97.072	Operaciones comerciales	Lloyds	(173)
04/10/2023	USD	4.201	JPY	606.920	Operaciones comerciales	Lloyds	131
04/10/2023	USD	30	JPY	4.412	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	1
04/10/2023	USD	19.687	EUR	18.211	Operaciones comerciales	NatWest Markets	403
04/10/2023	JPY	3.234	USD	22	Operaciones comerciales	JP Morgan	0
04/10/2023	CAD	643	USD	473	Operaciones comerciales	NatWest Markets	3
04/10/2023	CAD	1.870	USD	1.386	Operaciones comerciales	JP Morgan	(3)
04/10/2023	GBP	75.000	USD	91.416	Operaciones comerciales	Lloyds	128
04/10/2023	CAD	2.705	USD	2.006	Operaciones comerciales	JP Morgan	(5)
04/10/2023	AUD	199	USD	127	Operaciones comerciales	JP Morgan	1
							(84.009) USD

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - Global Focus tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	USD	29.662	SGD	40.463	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
19/10/2023	EUR	11.378	USD	11.968	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	88
19/10/2023	EUR	58.199	USD	61.650	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	20
19/10/2023	EUR	16.213	USD	17.314	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(135)
19/10/2023	EUR	44.023	USD	47.012	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(364)
19/10/2023	EUR	10.509	USD	11.213	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(78)
19/10/2023	EUR	5.196	USD	5.561	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(55)
19/10/2023	EUR	968	USD	1.035	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10)
19/10/2023	SGD	500	USD	367	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	2.613.910	USD	2.810.741	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(40.930)
19/10/2023	EUR	304.048	USD	326.956	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.774)
19/10/2023	EUR	7.183	USD	7.677	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(66)
19/10/2023	EUR	301	USD	321	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
19/10/2023	EUR	24.416	USD	25.849	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	23
19/10/2023	EUR	87.395.599	USD	93.976.610	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.368.474)
19/10/2023	SGD	420	USD	309	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/10/2023	CHF	817	USD	918	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(23)
19/10/2023	SGD	1.897.946	USD	1.396.572	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.776)
19/10/2023	EUR	25.487.893	USD	27.407.167	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(399.099)
19/10/2023	EUR	82.115.497	USD	88.298.908	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.285.796)
19/10/2023	EUR	8.839	USD	9.358	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
19/10/2023	USD	25	CHF	23	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	20	CHF	18	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	3.795	EUR	3.554	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	29

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	USD	969.431	EUR	907.792	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7.490
19/10/2023	USD	2.280	EUR	2.137	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	16
19/10/2023	USD	1.278	EUR	1.197	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
19/10/2023	USD	8.357	EUR	7.832	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	58
19/10/2023	USD	58.432	EUR	55.550	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(431)
19/10/2023	USD	1.251.604	EUR	1.189.879	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9.236)
19/10/2023	USD	1.230.244	EUR	1.151.976	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9.552
19/10/2023	EUR	248	USD	266	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
19/10/2023	USD	21.281	EUR	20.090	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
19/10/2023	EUR	692	USD	743	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
19/10/2023	EUR	71.311	USD	76.156	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(592)
19/10/2023	USD	22.269	EUR	20.852	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	173
19/10/2023	USD	1.315.176	EUR	1.225.656	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	16.404
19/10/2023	USD	131.476	EUR	122.527	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.640
19/10/2023	USD	8.494.510	EUR	7.960.848	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	58.804
19/10/2023	USD	2.516.062	EUR	2.358.671	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	16.699
19/10/2023	USD	743.511	EUR	697.001	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.935
19/10/2023	USD	2.356.534	EUR	2.209.122	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15.640
19/10/2023	USD	78.687	EUR	73.765	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	522
19/10/2023	USD	109.320	EUR	102.475	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	732
19/10/2023	USD	80.623	EUR	75.574	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	540
19/10/2023	USD	53.464	EUR	49.957	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	527
19/10/2023	USD	67.228	EUR	62.818	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	663
19/10/2023	USD	29.132	EUR	27.091	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	425
19/10/2023	USD	8.612	EUR	8.009	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	126
19/10/2023	SGD	28.349	USD	20.827	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(38)
19/10/2023	USD	23.284	EUR	22.029	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(59)
19/10/2023	USD	18.903	EUR	17.884	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(48)
19/10/2023	USD	11.550.459	EUR	10.927.777	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(29.060)
19/10/2023	USD	73.864	EUR	69.110	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	631
19/10/2023	USD	60.445	EUR	56.555	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	517
19/10/2023	USD	8.040	EUR	7.523	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	69
19/10/2023	USD	7.771	EUR	7.242	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	97
19/10/2023	USD	2.021.317	EUR	1.890.314	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	18.244
19/10/2023	USD	602.388	EUR	563.347	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5.437
19/10/2023	USD	1.766.056	EUR	1.651.597	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15.940
19/10/2023	USD	60.367	EUR	56.455	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	545
19/10/2023	USD	5.703	EUR	5.387	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
19/10/2023	USD	38.416	SGD	52.441	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(40)
19/10/2023	USD	15.606	SGD	21.219	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	46
19/10/2023	SGD	40.000	USD	29.285	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	48
19/10/2023	USD	13.730	EUR	12.871	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	92
19/10/2023	USD	14.119	EUR	13.328	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
							(2.967.338) USD

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	EUR	65.582	USD	70.520	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.027)
19/10/2023	EUR	837.360	USD	900.415	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13.112)
19/10/2023	EUR	368.047	USD	395.761	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5.763)
19/10/2023	EUR	491	USD	524	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
19/10/2023	EUR	99	USD	106	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/10/2023	USD	7.678	EUR	7.189	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	59
19/10/2023	USD	550	EUR	523	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
19/10/2023	USD	2.382	EUR	2.233	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	16
19/10/2023	USD	36.903	EUR	34.595	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	245
19/10/2023	USD	15.770	EUR	14.784	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	105
							(19.486) USD

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - Global Equity Income tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	AUD	56.396	USD	36.254	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	172
19/10/2023	USD	353	EUR	333	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/10/2023	USD	822	AUD	1.284	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
19/10/2023	USD	8.076	SGD	11.047	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(25)
19/10/2023	USD	75.063	SGD	102.676	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(231)
19/10/2023	USD	15	SGD	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	2.327	AUD	3.594	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
19/10/2023	USD	755	SGD	1.029	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/10/2023	SGD	7.328	USD	5.363	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	11
19/10/2023	SGD	893	USD	656	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/10/2023	SGD	298	USD	219	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	SGD	793	USD	583	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/10/2023	SGD	386.644	USD	284.506	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(973)
19/10/2023	SGD	29	USD	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	SGD	113	USD	83	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	SGD	458.156	USD	337.126	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.153)
19/10/2023	SGD	4.042.718	USD	2.974.767	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10.172)
19/10/2023	SGD	44	USD	32	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	712	USD	766	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
19/10/2023	EUR	12.826	USD	13.792	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(201)
19/10/2023	USD	20	EUR	19	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	6.916	SGD	9.467	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(27)
							(12.614) USD

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	EUR	28	GBP	24	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	122.025	GBP	106.022	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(112)
19/10/2023	EUR	3	GBP	3	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	698	GBP	607	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/10/2023	GBP	300	EUR	346	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/10/2023	CHF	15.000.000	EUR	15.608.205	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(100.455)
19/10/2023	GBP	50	EUR	58	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	GBP	666	EUR	774	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
19/10/2023	CHF	5.225.176	EUR	5.460.052	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(58.004)
19/10/2023	GBP	2.909.494	EUR	3.380.127	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(28.404)
19/10/2023	CHF	10.187.672	EUR	10.645.617	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(113.092)
19/10/2023	GBP	50	EUR	58	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	GBP	790	EUR	915	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
19/10/2023	EUR	395.738	CHF	381.471	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.353
19/10/2023	EUR	107.890	CHF	103.188	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.207
19/10/2023	EUR	111.369	CHF	107.550	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	179
							(297.342) EUR

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - American tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	USD	36.215	EUR	33.839	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	357
19/10/2023	USD	485	EUR	461	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
19/10/2023	USD	1.026	EUR	975	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8)
19/10/2023	USD	103.462	EUR	97.669	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(33)
19/10/2023	EUR	94.496	USD	100.042	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	90
19/10/2023	EUR	30.502	USD	32.730	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(409)
19/10/2023	EUR	27.657	USD	29.740	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(434)
19/10/2023	EUR	1.558	USD	1.665	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14)
19/10/2023	EUR	782	USD	841	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12)
19/10/2023	EUR	28.824.451	USD	30.994.973	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(451.345)
19/10/2023	EUR	85.728	USD	91.625	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(784)
19/10/2023	EUR	93.194	USD	98.505	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	248
19/10/2023	EUR	98	USD	104	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	833.609	USD	896.381	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13.053)
19/10/2023	EUR	780	USD	839	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12)
19/10/2023	EUR	137.113.521	USD	147.438.361	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.146.977)
19/10/2023	EUR	1.915.745	USD	2.060.003	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(29.998)
19/10/2023	EUR	37.811.681	USD	40.658.954	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(592.069)
19/10/2023	EUR	59.813	USD	63.875	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(494)
19/10/2023	EUR	3.155	USD	3.385	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(42)
19/10/2023	EUR	100	USD	107	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/10/2023	EUR	6.810	USD	7.163	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	53
19/10/2023	USD	7.719	EUR	7.303	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(19)

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	USD	22.897	EUR	21.663	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(58)
19/10/2023	USD	3.377.990	EUR	3.169.536	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19.397
19/10/2023	USD	331.276	EUR	309.955	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.832
19/10/2023	USD	6.591	EUR	6.266	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(49)
19/10/2023	USD	12.970	EUR	12.155	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	90
19/10/2023	USD	593.209	EUR	556.101	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.937
19/10/2023	USD	769.862	EUR	721.704	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5.109
19/10/2023	USD	2.948	EUR	2.754	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	29
19/10/2023	USD	19	EUR	18	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	19	EUR	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	1.063	EUR	995	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
19/10/2023	USD	17.169	EUR	16.095	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	114
19/10/2023	USD	16	EUR	15	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	3.534	EUR	3.310	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	27
19/10/2023	USD	16	EUR	15	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	2.880	EUR	2.699	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	20
19/10/2023	USD	17.344	EUR	16.255	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	120
19/10/2023	USD	47.350	EUR	44.385	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	317
19/10/2023	USD	1.447	EUR	1.356	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
19/10/2023	EUR	20.034	USD	21.396	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(166)
19/10/2023	USD	12.007	EUR	11.255	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	80
19/10/2023	USD	731	EUR	690	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/10/2023	USD	47.796	EUR	44.847	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	274
19/10/2023	USD	891.895	EUR	836.857	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5.121
19/10/2023	USD	686.225	EUR	643.879	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.940
19/10/2023	USD	88.326	EUR	82.314	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.102
19/10/2023	USD	20.418	EUR	19.158	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	117
19/10/2023	USD	471	EUR	445	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	4.083	EUR	3.797	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	60
19/10/2023	USD	8.685	EUR	8.076	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	127
19/10/2023	USD	699	EUR	655	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
19/10/2023	USD	2.827.829	EUR	2.650.936	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	18.768
19/10/2023	USD	39.467	EUR	36.998	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	262
19/10/2023	USD	1.202	EUR	1.127	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
19/10/2023	EUR	9.440	USD	10.000	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
							(3.173.357) USD

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - American Select tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	EUR	37	USD	39	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	352	EUR	330	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
19/10/2023	USD	566	EUR	530	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
19/10/2023	USD	8.160	EUR	7.656	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	48
19/10/2023	USD	4.491	EUR	4.176	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	66

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	USD	19.335	EUR	18.126	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	128
19/10/2023	USD	6.736	EUR	6.314	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	45
19/10/2023	USD	25	EUR	24	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	12.839	EUR	12.031	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	91
19/10/2023	USD	4.422	EUR	4.144	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	31
19/10/2023	USD	17	EUR	16	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	4.480	EUR	4.198	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	32
19/10/2023	USD	231	EUR	217	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
19/10/2023	USD	372	EUR	349	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
19/10/2023	EUR	557.313	USD	599.280	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8.728)
19/10/2023	EUR	352.004	USD	378.510	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5.512)
19/10/2023	EUR	193.380	USD	207.942	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.028)
19/10/2023	EUR	193.285	USD	207.839	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.027)
19/10/2023	EUR	10.094	USD	10.854	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(158)
19/10/2023	EUR	16.232	USD	17.455	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(254)
19/10/2023	EUR	725	USD	780	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
19/10/2023	EUR	34	USD	36	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	34	USD	36	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	34	USD	36	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	6.752	EUR	6.330	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	45
19/10/2023	USD	7.544	EUR	7.078	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	43
							(20.178) USD

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	USD	2.474.030	EUR	2.319.269	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	16.420
19/10/2023	CHF	11.411	USD	12.746	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(245)
19/10/2023	CHF	8.268	USD	9.036	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	22
19/10/2023	CHF	13.837	USD	15.455	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(296)
19/10/2023	CHF	311	USD	345	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
19/10/2023	CHF	8.993	USD	9.794	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	58
19/10/2023	CHF	13.130	USD	14.401	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17)
19/10/2023	CHF	3.934	USD	4.412	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(102)
19/10/2023	CHF	15.532	USD	17.455	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(439)
19/10/2023	EUR	63.413	USD	68.188	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(993)
19/10/2023	CHF	24.199.274	USD	27.191.625	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(681.030)
19/10/2023	USD	26	SGD	35	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	35.270	EUR	33.000	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	302
19/10/2023	USD	4.320	EUR	4.049	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	29
19/10/2023	USD	6.877	EUR	6.452	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	40
19/10/2023	USD	556	EUR	521	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
19/10/2023	USD	35.248	EUR	33.005	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	274
19/10/2023	USD	1.477	CHF	1.346	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
19/10/2023	USD	552.880	CHF	500.936	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.089

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	USD	17	SGD	23	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	63.819.894	USD	68.625.622	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(999.318)
19/10/2023	EUR	6.168	USD	6.618	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(83)
19/10/2023	EUR	37.992	USD	40.572	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(314)
19/10/2023	USD	2.455	EUR	2.302	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	16
19/10/2023	USD	100.911	EUR	94.599	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	670
19/10/2023	USD	5.032	CHF	4.489	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	113
19/10/2023	USD	574.958	CHF	515.805	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9.867
19/10/2023	USD	6.990	EUR	6.559	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	40
19/10/2023	USD	13	SGD	18	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	11.743	EUR	10.920	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	171
19/10/2023	SGD	20	USD	15	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	SGD	18	USD	13	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	SGD	1.353	USD	995	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
19/10/2023	EUR	313.801	USD	337.431	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.914)
19/10/2023	EUR	2.593.578	USD	2.788.878	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(40.611)
19/10/2023	EUR	132.232	USD	141.515	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.396)
19/10/2023	EUR	637.717	USD	674.055	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.697
19/10/2023	EUR	30.000	USD	32.064	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(274)
19/10/2023	EUR	500	USD	529	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	70.000	USD	74.676	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(501)
19/10/2023	EUR	131.689	USD	138.520	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.023
19/10/2023	EUR	5.166	USD	5.513	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(38)
19/10/2023	USD	12.217	CHF	10.926	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	248
19/10/2023	USD	2.177	CHF	1.961	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	29
							(1.695.463) USD

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	EUR	534	USD	574	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8)
19/10/2023	USD	13	EUR	13	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	2.896	SGD	3.947	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
19/10/2023	USD	13	SGD	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	480	SGD	654	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/10/2023	USD	5.923	SGD	8.108	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(23)
19/10/2023	USD	19	SGD	26	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	4.838	SGD	6.610	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
19/10/2023	USD	15	SGD	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	4.587	SGD	6.242	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
19/10/2023	USD	4.053	SGD	5.532	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
19/10/2023	SGD	6.920	USD	5.070	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
19/10/2023	SGD	22	USD	16	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	13	USD	14	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	SGD	286.184	USD	210.584	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(721)

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	SGD	870	USD	640	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
19/10/2023	USD	17	EUR	16	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	11	EUR	11	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
							(751) USD

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - Asia Equities tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	EUR	502	USD	540	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8)
19/10/2023	EUR	508	USD	546	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8)
19/10/2023	EUR	11	USD	12	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	11	USD	12	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	14	EUR	13	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	14	EUR	13	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	11	EUR	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	11	EUR	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	11	EUR	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	11	EUR	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
							(16) USD

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	USD	28	CHF	25	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	2.746	EUR	2.566	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	27
19/10/2023	USD	2.122	EUR	2.007	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
19/10/2023	USD	6.374	EUR	5.940	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	80
19/10/2023	USD	13.492	EUR	12.634	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	104
19/10/2023	USD	23	EUR	22	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	24	CHF	22	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	139.187	EUR	130.598	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	799
19/10/2023	USD	17.489	EUR	16.409	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	100
19/10/2023	USD	4.378	EUR	4.162	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(32)
19/10/2023	USD	3.219	EUR	3.060	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(24)
19/10/2023	USD	13.438	EUR	12.573	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	115
19/10/2023	USD	25.210	EUR	23.444	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	368
19/10/2023	USD	20.630	EUR	19.499	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(32)
19/10/2023	USD	326	EUR	308	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	2.910	EUR	2.728	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19
19/10/2023	USD	4.613	EUR	4.323	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	32
19/10/2023	USD	2.680.346	SGD	3.658.924	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.802)
19/10/2023	USD	24	GBP	20	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	477	EUR	451	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	SGD	128.655.677	USD	94.669.128	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(323.733)
19/10/2023	GBP	728	USD	909	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(21)
19/10/2023	EUR	5.772.528	USD	6.207.207	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(90.389)
19/10/2023	EUR	715.553	USD	769.435	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11.204)
19/10/2023	EUR	130.332	USD	139.187	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.082)
19/10/2023	EUR	944	USD	1.015	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(15)
19/10/2023	CHF	919	USD	1.033	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(26)
19/10/2023	USD	21	EUR	20	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	167.808	EUR	158.610	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(261)
							(427.982) USD

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	EUR	840	USD	903	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13)
19/10/2023	EUR	41.063	USD	44.155	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(642)
19/10/2023	EUR	863	USD	928	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14)
19/10/2023	CHF	949	USD	1.067	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(26)
19/10/2023	CHF	939	USD	1.055	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(26)
19/10/2023	USD	23	EUR	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	23	EUR	22	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	1.065	EUR	999	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
19/10/2023	USD	23	EUR	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	878	USD	944	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14)
19/10/2023	USD	19	EUR	18	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	22	EUR	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	25	EUR	24	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	25	EUR	24	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	1.183	EUR	1.118	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
19/10/2023	USD	27	CHF	24	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	29	CHF	26	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	28	CHF	26	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	27	CHF	24	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	25	EUR	23	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	875	USD	940	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14)
							(745) USD

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	EUR	8.225	SGD	12.000	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(79)
19/10/2023	USD	108.569	EUR	100.966	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.492
19/10/2023	SGD	16.647	EUR	11.391	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	129

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	SGD	4.581	EUR	3.167	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
19/10/2023	SGD	18.918	EUR	13.014	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	78
19/10/2023	SGD	10.399	EUR	7.215	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(18)
19/10/2023	SGD	12.473	EUR	8.580	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	52
19/10/2023	SGD	9.711	EUR	6.663	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	57
19/10/2023	USD	141.426	EUR	131.522	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.944
19/10/2023	SGD	5.668	EUR	3.889	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	34
19/10/2023	SGD	6.589	EUR	4.565	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
19/10/2023	EUR	27.665	SGD	40.296	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(221)
19/10/2023	EUR	2.868	USD	3.034	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
19/10/2023	EUR	2.113	USD	2.235	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
19/10/2023	EUR	184.179	SGD	266.633	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(342)
19/10/2023	EUR	841	SGD	1.217	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
19/10/2023	EUR	3.689	SGD	5.361	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(21)
19/10/2023	SGD	11.601.169	EUR	7.938.734	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	89.751
19/10/2023	USD	99	EUR	93	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
							92.860 EUR

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	EUR	1.271	CHF	1.217	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12
19/10/2023	USD	532	EUR	498	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
19/10/2023	USD	64.679	EUR	60.150	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	889
19/10/2023	USD	3.054	EUR	2.840	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	42
19/10/2023	CHF	57.470	EUR	60.054	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(638)
19/10/2023	EUR	1.914	SGD	2.791	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17)
19/10/2023	EUR	150.010	SGD	218.823	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.425)
19/10/2023	EUR	8.308	SGD	12.121	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(80)
19/10/2023	EUR	54.382	USD	58.075	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(424)
19/10/2023	EUR	526	SGD	767	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
19/10/2023	EUR	211.287	SGD	306.004	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(480)
19/10/2023	EUR	1.747	CHF	1.691	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/10/2023	EUR	167	USD	176	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	72	USD	76	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	3.013	SGD	4.362	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
19/10/2023	EUR	987	SGD	1.428	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/10/2023	EUR	29.105	SGD	42.533	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(330)
19/10/2023	EUR	2.588	SGD	3.770	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(21)
19/10/2023	EUR	142	USD	152	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/10/2023	EUR	58	USD	62	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/10/2023	SGD	10.555.421	EUR	7.223.124	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	81.661
19/10/2023	SGD	30	EUR	20	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	SGD	15.911	EUR	10.945	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	66

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	SGD	10.300	EUR	7.146	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(18)
19/10/2023	SGD	1.209	EUR	832	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
19/10/2023	SGD	2.670	EUR	1.849	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
							79.229 EUR

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	EUR	16.666	USD	17.823	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(154)
19/10/2023	EUR	7.794	CHF	7.544	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
19/10/2023	EUR	7.230	CHF	6.927	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	69
19/10/2023	EUR	50.672	CHF	49.043	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(32)
19/10/2023	USD	7.788.769	EUR	7.243.336	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	107.035
19/10/2023	CHF	281.075	EUR	293.710	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.120)
19/10/2023	USD	760.306	EUR	707.063	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10.448
19/10/2023	CHF	15.000	EUR	15.548	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(40)
19/10/2023	CHF	1.812.090	EUR	1.893.545	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20.116)
19/10/2023	USD	15.180.634	EUR	14.117.562	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	208.616
19/10/2023	CHF	5.721.005	EUR	5.978.169	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(63.508)
19/10/2023	CHF	4.476	EUR	4.657	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(30)
19/10/2023	EUR	336.909	USD	360.305	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.119)
19/10/2023	EUR	191.806	USD	202.931	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	298
19/10/2023	EUR	158.874	CHF	153.768	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(99)
19/10/2023	EUR	18.718	USD	19.803	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	29
19/10/2023	EUR	26.259	USD	27.817	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
19/10/2023	EUR	375.429	USD	397.202	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	584
19/10/2023	EUR	33.816	USD	36.075	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(228)
19/10/2023	EUR	170.816	USD	182.678	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.581)
19/10/2023	EUR	147.227	CHF	141.051	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.400
19/10/2023	EUR	47.086	CHF	45.111	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	448
							236.903 EUR

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - European Select tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	EUR	34	USD	36	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	GBP	5.652.749	EUR	6.567.123	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(55.185)
19/10/2023	GBP	225	EUR	260	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	SGD	4.521	EUR	3.125	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
19/10/2023	SGD	99	EUR	68	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	SGD	3.868	EUR	2.680	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
19/10/2023	SGD	25.020.930	EUR	17.121.939	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	193.571
19/10/2023	SGD	99	EUR	68	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	SGD	198	EUR	136	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/10/2023	SGD	18.748	EUR	12.897	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	77
19/10/2023	USD	2.190	EUR	2.069	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
19/10/2023	USD	2.975	EUR	2.810	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
19/10/2023	USD	1.389	EUR	1.300	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
19/10/2023	USD	100	EUR	95	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/10/2023	USD	565.380	EUR	525.788	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7.770
19/10/2023	USD	992	EUR	923	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	14
19/10/2023	GBP	669.198	EUR	777.446	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6.533)
19/10/2023	USD	20.835.920	EUR	19.376.818	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	286.331
19/10/2023	EUR	447	SGD	652	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
19/10/2023	EUR	14.851	GBP	12.852	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	46
19/10/2023	EUR	16.688	SGD	24.306	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(133)
19/10/2023	EUR	157.094	GBP	136.605	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(275)
19/10/2023	EUR	18.954	GBP	16.482	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(33)
19/10/2023	EUR	23	USD	24	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	12.262	USD	12.974	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19
19/10/2023	EUR	83.784	SGD	121.303	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(163)
19/10/2023	EUR	7.909	SGD	11.400	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	20
19/10/2023	EUR	8.945	GBP	7.753	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	14
19/10/2023	EUR	56.079	GBP	48.415	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	306
19/10/2023	EUR	3.482	GBP	3.022	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/10/2023	EUR	479.541	USD	507.373	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	727
19/10/2023	EUR	431.276	SGD	624.352	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(801)
19/10/2023	EUR	105.005	SGD	153.062	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(920)
19/10/2023	EUR	333	GBP	286	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
19/10/2023	EUR	25.498	USD	27.229	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(199)
19/10/2023	EUR	981	USD	1.048	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8)
19/10/2023	USD	262	EUR	245	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
							424.653 EUR

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	EUR	16	CHF	15	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	209.495	CHF	202.310	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	336
19/10/2023	EUR	59	CHF	57	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	16	CHF	15	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	209.047	CHF	202.329	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(130)
19/10/2023	EUR	58	CHF	57	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	CHF	9.905.930	EUR	10.351.210	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(109.964)
19/10/2023	CHF	2.771	EUR	2.895	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(31)
19/10/2023	CHF	737	EUR	770	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8)
							(109.797) EUR

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	USD	110.553	EUR	104.493	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(172)
19/10/2023	USD	35.270	EUR	33.064	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	234
19/10/2023	SGD	1.283	USD	944	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
19/10/2023	GBP	148.909	USD	186.027	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.253)
19/10/2023	EUR	99	USD	104	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	1.126.320	USD	1.211.133	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17.636)
19/10/2023	EUR	4.154.801	USD	4.467.663	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(65.057)
19/10/2023	SGD	28	USD	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	91.366	USD	97.386	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(571)
19/10/2023	USD	131.237	EUR	123.028	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	871
19/10/2023	EUR	96	USD	103	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/10/2023	EUR	24.802	USD	26.436	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(155)
19/10/2023	EUR	100	USD	107	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/10/2023	USD	24	SGD	32	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	27	SGD	38	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	4.517	GBP	3.716	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20)
19/10/2023	USD	5.209	GBP	4.242	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	31
19/10/2023	USD	34.261	EUR	32.572	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(253)
19/10/2023	USD	29.887	EUR	28.249	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(46)
19/10/2023	GBP	3.296	USD	4.037	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14)
19/10/2023	USD	4.203	EUR	3.976	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
							(87.057) USD

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - Global Technology tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	EUR	2.215.470	USD	2.382.298	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(34.690)
19/10/2023	EUR	13.947	USD	14.765	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
19/10/2023	EUR	10.107	USD	10.700	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
19/10/2023	EUR	100	USD	108	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
19/10/2023	EUR	27.175	USD	29.222	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(427)
19/10/2023	EUR	8	USD	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	2.988	USD	3.158	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
19/10/2023	EUR	22.168	USD	23.432	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	59
19/10/2023	EUR	5.333.091	USD	5.734.681	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(83.507)
19/10/2023	EUR	44.705.633	USD	48.072.029	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(700.018)
19/10/2023	EUR	27.021.469	USD	29.056.224	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(423.112)
19/10/2023	EUR	389	USD	416	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
19/10/2023	EUR	67.609	USD	72.141	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(500)
19/10/2023	EUR	3.213	USD	3.379	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	25
19/10/2023	EUR	5.622	USD	5.913	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	44
19/10/2023	USD	1.343.019	EUR	1.254.921	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13.239
19/10/2023	USD	3.548	EUR	3.320	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	30
19/10/2023	USD	6.434	EUR	5.996	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	80

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	EUR	45.661	USD	48.762	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(377)
19/10/2023	USD	18.433	CHF	16.652	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	190
19/10/2023	EUR	16.293	USD	17.483	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(218)
19/10/2023	EUR	15.942	USD	17.025	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(132)
19/10/2023	EUR	72.614	USD	77.711	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(767)
19/10/2023	USD	2.159	EUR	2.024	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15
19/10/2023	USD	58.464	EUR	54.807	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	388
19/10/2023	USD	4.300	EUR	4.068	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
19/10/2023	USD	4.248	EUR	3.950	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	62
19/10/2023	USD	683.685	EUR	640.917	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.537
19/10/2023	USD	1.493.544	EUR	1.400.116	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9.912
19/10/2023	USD	177.610	EUR	166.499	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.179
19/10/2023	USD	111.379	EUR	104.405	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	746
19/10/2023	USD	7.091	EUR	6.694	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
19/10/2023	USD	59.785	EUR	56.021	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	423
19/10/2023	CHF	527.249	USD	592.446	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14.838)
19/10/2023	EUR	41.421	USD	44.270	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(379)
19/10/2023	EUR	76.212	USD	81.390	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(633)
19/10/2023	EUR	98	USD	105	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/10/2023	EUR	25.872	USD	27.762	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(347)
19/10/2023	EUR	56.550	USD	59.904	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19
19/10/2023	EUR	17.337	USD	18.496	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(124)
19/10/2023	USD	728.453	EUR	682.589	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5.148
							(1.223.962) USD

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - UK Equities tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	CHF	69.019	GBP	62.078	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(137)
19/10/2023	EUR	832	GBP	716	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
19/10/2023	USD	1.042	GBP	834	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	20
19/10/2023	EUR	570	GBP	491	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
19/10/2023	GBP	22.503	EUR	26.166	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(211)
19/10/2023	GBP	635	EUR	734	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
19/10/2023	GBP	18.709	EUR	21.613	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(53)
19/10/2023	EUR	1.146.720	GBP	987.056	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8.365
19/10/2023	EUR	2.479.367	GBP	2.134.152	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	18.086
19/10/2023	EUR	1.142.529	GBP	983.449	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8.334
19/10/2023	USD	33	GBP	27	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	941	GBP	817	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	GBP	21	USD	26	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	GBP	36.516	USD	44.302	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	224
19/10/2023	CHF	908	GBP	817	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
19/10/2023	GBP	21	USD	26	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	GBP	21	USD	25	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	GBP	54.727	EUR	63.223	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(154)
19/10/2023	GBP	25.009	EUR	28.892	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(71)
19/10/2023	GBP	42.774	EUR	49.650	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(325)
19/10/2023	GBP	10.825	EUR	12.565	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(82)
19/10/2023	GBP	25.169	EUR	29.076	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(71)
19/10/2023	GBP	18	EUR	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	GBP	18	EUR	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	GBP	3.535	EUR	4.083	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10)
19/10/2023	GBP	935	CHF	1.043	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/10/2023	GBP	1.639	CHF	1.829	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
19/10/2023	GBP	21	CHF	24	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	GBP	21	CHF	24	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	GBP	21	USD	26	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	1.041	GBP	834	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	20
19/10/2023	CHF	1.914	GBP	1.726	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8)
19/10/2023	EUR	37.870	GBP	32.536	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	337
19/10/2023	EUR	38.881	GBP	33.567	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	184
19/10/2023	EUR	29.921	GBP	25.755	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	218
19/10/2023	EUR	25.777	GBP	22.147	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	229
19/10/2023	USD	32	GBP	26	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	73.375	GBP	63.041	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	652
19/10/2023	CHF	897	GBP	807	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
19/10/2023	EUR	160.588	GBP	138.229	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.171
19/10/2023	USD	1.793.794	GBP	1.435.880	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	33.596
19/10/2023	CHF	26	GBP	24	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	25	GBP	22	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	33	GBP	27	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	CHF	26	GBP	24	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	25	GBP	22	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	33	GBP	26	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	CHF	26	GBP	23	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	4.850	GBP	4.167	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	43
19/10/2023	USD	56.623	GBP	45.567	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	819
19/10/2023	CHF	25	GBP	23	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	34.827	GBP	29.922	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	310
19/10/2023	EUR	812	GBP	698	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
19/10/2023	CHF	1.126	GBP	1.015	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
19/10/2023	CHF	892	GBP	802	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
19/10/2023	CHF	909	GBP	817	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
19/10/2023	EUR	832	GBP	716	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
19/10/2023	EUR	28.180	GBP	24.256	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	206
19/10/2023	CHF	39.748	GBP	35.751	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(79)
19/10/2023	EUR	845.751	GBP	727.993	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6.169
19/10/2023	USD	1.027	GBP	822	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19
19/10/2023	USD	1.032	GBP	826	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19
19/10/2023	GBP	21	CHF	23	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	GBP	21	CHF	23	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
							77.825 GBP

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - UK Equity Income tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	GBP	17.088	EUR	19.715	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(26)
19/10/2023	CHF	2.627	GBP	2.369	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
19/10/2023	CHF	67.707	GBP	60.898	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(135)
19/10/2023	CHF	21	GBP	19	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	CHF	12.686	GBP	11.439	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(54)
19/10/2023	CHF	1.455	GBP	1.312	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
19/10/2023	CHF	120.781	GBP	108.635	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(241)
19/10/2023	CHF	961	GBP	864	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
19/10/2023	CHF	581.151	GBP	522.707	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.157)
19/10/2023	USD	61.244	GBP	49.442	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	729
19/10/2023	USD	17.886	GBP	14.440	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	213
19/10/2023	GBP	14.544	USD	17.702	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	43
19/10/2023	GBP	68	SGD	113	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	19.015	GBP	15.351	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	226
19/10/2023	USD	600	GBP	483	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
19/10/2023	USD	1.118	GBP	895	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	21
19/10/2023	USD	892.923	GBP	714.759	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	16.723
19/10/2023	USD	29.337	GBP	23.483	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	549
19/10/2023	USD	782.384	GBP	626.276	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	14.653
19/10/2023	USD	2.000	GBP	1.643	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
19/10/2023	USD	20.646	GBP	16.668	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	246
19/10/2023	USD	23	GBP	18	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	834.766	GBP	668.206	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15.634
19/10/2023	USD	2.687.691	GBP	2.151.420	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	50.336
19/10/2023	EUR	1.372.641	GBP	1.181.521	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10.013
19/10/2023	SGD	114	GBP	68	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/10/2023	EUR	9.000	GBP	7.766	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	46
19/10/2023	EUR	112.585	GBP	96.909	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	821
19/10/2023	GBP	12.597	EUR	14.534	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(19)
19/10/2023	GBP	9.310	EUR	10.826	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(87)
19/10/2023	GBP	8.169	EUR	9.394	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	14
19/10/2023	GBP	20.953	EUR	24.283	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(125)
19/10/2023	GBP	2.170	EUR	2.496	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
19/10/2023	GBP	1.330	USD	1.650	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(21)
19/10/2023	EUR	5.165	GBP	4.451	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	33
19/10/2023	EUR	1.048	GBP	903	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
19/10/2023	EUR	29.593	GBP	25.501	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	187
19/10/2023	EUR	230.035	GBP	198.006	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.678
19/10/2023	EUR	48.304	GBP	41.578	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	352
19/10/2023	EUR	1.343.455	GBP	1.156.398	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9.800
19/10/2023	EUR	108	GBP	93	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/10/2023	EUR	889	GBP	766	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
19/10/2023	EUR	1.467.288	GBP	1.262.990	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10.703
19/10/2023	EUR	10.379	GBP	9.034	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(24)
19/10/2023	EUR	20	GBP	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	30.800	GBP	26.541	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	195
19/10/2023	EUR	32.394	GBP	27.915	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	205
19/10/2023	EUR	16.616	GBP	14.318	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	105

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	EUR	2.442	GBP	2.105	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15
19/10/2023	EUR	9.426	GBP	8.123	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	60
19/10/2023	EUR	743.015	GBP	639.561	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5.420
19/10/2023	EUR	427.913	GBP	368.333	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.121
19/10/2023	SGD	5.187	GBP	3.055	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	61
							140.317 GBP

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	EUR	2.421	GBP	2.103	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/10/2023	GBP	55	EUR	64	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	1.188	GBP	1.033	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
19/10/2023	EUR	15	GBP	13	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	GBP	642	EUR	745	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
19/10/2023	GBP	11.681	EUR	13.432	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	23
19/10/2023	GBP	108	EUR	125	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	1.915.532	EUR	1.781.391	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	26.324
19/10/2023	GBP	10.788	EUR	12.534	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(105)
19/10/2023	GBP	3.669.056	EUR	4.262.553	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(35.819)
19/10/2023	GBP	1.244.370	EUR	1.445.656	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12.148)
19/10/2023	GBP	658	EUR	764	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
19/10/2023	GBP	1.002.936	EUR	1.165.168	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9.791)
19/10/2023	GBP	646	EUR	748	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
19/10/2023	EUR	3.240	GBP	2.795	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19
19/10/2023	EUR	22.604	GBP	19.675	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(61)
19/10/2023	EUR	16.074	GBP	13.932	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	25
19/10/2023	EUR	68	GBP	59	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	29	GBP	25	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	18.456	GBP	15.900	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	139
19/10/2023	EUR	39	GBP	34	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	GBP	75.781	EUR	88.039	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(740)
19/10/2023	EUR	809	GBP	696	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
19/10/2023	EUR	20.269	GBP	17.447	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	170
19/10/2023	EUR	4.553	GBP	3.940	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	14
05/10/2023	USD	170.215	EUR	158.379	Operaciones comerciales	JP Morgan	2.353
05/10/2023	EUR	34.336.921	GBP	29.376.163	Operaciones comerciales	Lloyds	478.374
05/10/2023	EUR	917.471	GBP	795.420	Operaciones comerciales	NatWest Markets	679
05/10/2023	EUR	26.906.046	USD	28.954.914	Operaciones comerciales	Lloyds	(435.834)
05/10/2023	GBP	138.000	EUR	160.225	Operaciones comerciales	NatWest Markets	(1.167)
05/10/2023	EUR	156.874	USD	166.815	Operaciones comerciales	NatWest Markets	(648)
05/10/2023	USD	294.374	EUR	279.970	Operaciones comerciales	JP Morgan	(1.997)
05/10/2023	USD	700.000	EUR	657.632	Operaciones comerciales	Barclays	3.369
05/10/2023	USD	219.560	EUR	206.163	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	1.165
05/10/2023	USD	161.206	EUR	152.026	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	198
05/10/2023	USD	161.071	EUR	150.149	Operaciones comerciales	JP Morgan	1.949
05/10/2023	USD	72.523	EUR	67.965	Operaciones comerciales	NatWest Markets	518

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
05/10/2023	USD	1.755.370	EUR	1.643.651	Operaciones comerciales	NatWest Markets	13.924
05/10/2023	USD	73.491	EUR	68.471	Operaciones comerciales	Lloyds	926
05/10/2023	GBP	819.290	EUR	952.129	Operaciones comerciales	Lloyds	(7.825)
05/10/2023	EUR	363.733	USD	387.756	Operaciones comerciales	Barclays	(2.421)
05/10/2023	GBP	500.000	EUR	575.081	Operaciones comerciales	NatWest Markets	1.214
05/10/2023	USD	543.409	EUR	507.806	Operaciones comerciales	JP Morgan	5.329
05/10/2023	EUR	196.037	GBP	167.746	Operaciones comerciales	JP Morgan	2.695
05/10/2023	EUR	109.517	GBP	95.229	Operaciones comerciales	Lloyds	(243)
05/10/2023	USD	2.956.000	EUR	2.808.106	Operaciones comerciales	NatWest Markets	(16.790)
05/10/2023	EUR	115.645	USD	123.998	Operaciones comerciales	Lloyds	(1.445)
							12.362 EUR

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Fund tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	EUR	1.629.569	GBP	1.410.214	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5.012
19/10/2023	USD	10	EUR	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	974	EUR	906	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
19/10/2023	GBP	698	EUR	810	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
19/10/2023	USD	5.986	EUR	5.567	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	82
19/10/2023	CHF	844	EUR	882	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
19/10/2023	USD	981	EUR	912	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
19/10/2023	USD	10	EUR	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	10	EUR	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	11	EUR	11	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	NOK	8.121	EUR	706	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	14
19/10/2023	SEK	8.003	EUR	670	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	26
19/10/2023	GBP	5.580.542	EUR	6.483.237	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(54.479)
19/10/2023	GBP	703	EUR	816	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
19/10/2023	USD	971	EUR	903	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
19/10/2023	GBP	704	EUR	817	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
19/10/2023	USD	977	EUR	908	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
19/10/2023	GBP	706	EUR	821	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
19/10/2023	USD	969	EUR	901	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
19/10/2023	CHF	854	EUR	892	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
19/10/2023	NOK	8.299	EUR	722	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15
19/10/2023	GBP	708	EUR	823	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
04/10/2023	EUR	16.565	USD	17.659	Operaciones comerciales	Barclays	(110)
04/10/2023	EUR	1.671.208	USD	1.817.799	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(45.407)
04/10/2023	USD	14.379	EUR	13.380	Operaciones comerciales	JP Morgan	198
04/10/2023	GBP	80.000	EUR	93.208	Operaciones comerciales	JP Morgan	(997)
04/10/2023	GBP	158.290	EUR	183.523	Operaciones comerciales	Barclays	(1.072)
04/10/2023	EUR	13.526	GBP	11.577	Operaciones comerciales	Barclays	183
04/10/2023	USD	134.350	EUR	125.189	Operaciones comerciales	JP Morgan	1.682
04/10/2023	USD	7.120	EUR	6.742	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(19)
04/10/2023	USD	185.000	EUR	174.006	Operaciones comerciales	JP Morgan	695

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
04/10/2023	USD	427.430	EUR	400.766	Operaciones comerciales	Barclays	2.870
04/10/2023	EUR	2.273.844	GBP	1.950.202	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	25.976
04/10/2023	GBP	267.910	EUR	311.348	Operaciones comerciales	Barclays	(2.546)
04/10/2023	USD	7.265	EUR	6.910	Operaciones comerciales	JP Morgan	(49)
04/10/2023	USD	26.371	EUR	24.644	Operaciones comerciales	JP Morgan	259
04/10/2023	GBP	110.000	EUR	128.197	Operaciones comerciales	Barclays	(1.407)
04/10/2023	GBP	590.000	EUR	678.259	Operaciones comerciales	Barclays	1.796
04/10/2023	GBP	9.122	EUR	10.560	Operaciones comerciales	JP Morgan	(46)
04/10/2023	USD	10.000	EUR	9.285	Operaciones comerciales	Barclays	159
04/10/2023	USD	14.870	EUR	13.862	Operaciones comerciales	JP Morgan	180
							(66.973) EUR

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	EUR	22	CHF	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	GBP	769	EUR	893	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8)
19/10/2023	GBP	238	EUR	274	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/10/2023	CHF	900	EUR	940	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10)
19/10/2023	USD	1.050	EUR	976	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	14
19/10/2023	GBP	182.700	EUR	212.253	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.784)
19/10/2023	GBP	767	EUR	891	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
19/10/2023	EUR	18	GBP	16	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	4.229	GBP	3.658	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15
19/10/2023	EUR	20	GBP	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	17	GBP	15	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	21	USD	22	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	EUR	20	USD	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
							(1.779) EUR

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	EUR	420	USD	448	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
19/10/2023	EUR	4.780	USD	5.140	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(75)
19/10/2023	EUR	15.510	USD	16.678	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(243)
19/10/2023	EUR	1.794.783	USD	1.929.933	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(28.104)
19/10/2023	USD	116	EUR	109	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/10/2023	USD	377	EUR	353	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
19/10/2023	USD	43.626	EUR	40.897	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	290
19/10/2023	USD	106	EUR	99	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/10/2023	USD	338	EUR	316	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
19/10/2023	USD	38.862	EUR	36.344	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	350
							(27.777) USD

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	EUR	157.194	USD	169.031	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.462)
19/10/2023	USD	15	EUR	14	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	3.363	EUR	3.155	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	20
19/10/2023	USD	18	EUR	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	4.133	EUR	3.878	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	24
19/10/2023	EUR	690	USD	742	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
							(2.429) USD

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	USD	3.293	SGD	4.478	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
19/10/2023	USD	265	CHF	237	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
19/10/2023	USD	5.538	EUR	5.186	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	43
19/10/2023	USD	5.720	EUR	5.331	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	71
19/10/2023	USD	10.168	EUR	9.604	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
19/10/2023	USD	2.153	EUR	2.035	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
19/10/2023	USD	26.509	GBP	21.780	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(78)
19/10/2023	USD	37.266	SGD	50.974	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(115)
19/10/2023	USD	639.612	GBP	525.506	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.875)
19/10/2023	USD	43.872	EUR	41.049	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	375
19/10/2023	USD	15.833	SGD	21.640	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(36)
19/10/2023	USD	13.666	SGD	18.727	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(67)
19/10/2023	USD	73	SGD	100	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	2.509	SGD	3.420	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
19/10/2023	USD	268.214	SGD	365.524	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	169
19/10/2023	EUR	4.997.735	USD	5.374.071	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(78.256)
19/10/2023	USD	1.425	GBP	1.150	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	22
19/10/2023	EUR	6.153.738	USD	6.617.123	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(96.357)
19/10/2023	USD	4.740	GBP	3.894	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14)
19/10/2023	USD	12	CHF	11	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	USD	10.432	GBP	8.552	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
19/10/2023	USD	3.131	EUR	2.962	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8)
19/10/2023	USD	9.455	GBP	7.638	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	132
19/10/2023	USD	77.880	EUR	73.608	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(118)
19/10/2023	USD	18.280	EUR	17.278	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(28)
19/10/2023	USD	10.649	GBP	8.749	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(31)
19/10/2023	USD	68.169	EUR	64.430	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(103)
19/10/2023	USD	35.909	GBP	29.273	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	176
19/10/2023	USD	12.167	GBP	10.025	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(71)
19/10/2023	USD	83	EUR	79	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
19/10/2023	USD	4.588	EUR	4.362	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(34)
19/10/2023	USD	34.923	GBP	28.173	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	533
19/10/2023	USD	1.184	GBP	963	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
19/10/2023	USD	205.962	GBP	167.608	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.362
19/10/2023	USD	23.354	EUR	21.891	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	156

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera
19/10/2023	USD	21.343	CHF	19.338	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	158
19/10/2023	GBP	45.756.372	USD	57.161.784	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.306.842)
19/10/2023	GBP	752.982	USD	940.673	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(21.506)
19/10/2023	GBP	2.441	USD	3.049	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(70)
19/10/2023	SGD	3.015	USD	2.214	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
19/10/2023	GBP	1.961.973	USD	2.451.022	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(56.036)
19/10/2023	EUR	165.791	USD	178.276	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.596)
19/10/2023	GBP	12.526	USD	15.532	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(241)
19/10/2023	EUR	1.000	USD	1.068	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8)
19/10/2023	EUR	1.395.048	USD	1.500.097	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(21.844)
19/10/2023	EUR	1.000	USD	1.059	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/10/2023	CHF	5.172	USD	5.632	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	33
19/10/2023	CHF	12	USD	13	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2023	CHF	20.458	USD	23.002	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(590)
19/10/2023	CHF	1.836.646	USD	2.063.755	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(51.688)
19/10/2023	CHF	1.025	USD	1.152	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(29)
19/10/2023	USD	6.575	GBP	5.295	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	112
19/10/2023	USD	25.491	GBP	20.528	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	432
19/10/2023	USD	68.442	EUR	64.090	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	529
19/10/2023	EUR	20.000	USD	21.404	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(211)
19/10/2023	GBP	1.642	USD	2.003	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/10/2023	GBP	2.063	USD	2.554	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(36)
19/10/2023	SGD	4.593.092	USD	3.379.750	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11.557)
19/10/2023	EUR	55.551	USD	59.372	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(508)
19/10/2023	EUR	73.347	USD	78.704	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(982)
19/10/2023	EUR	57.051	USD	60.434	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19
19/10/2023	GBP	13.559	USD	16.502	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	50
19/10/2023	EUR	80.786	USD	86.182	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(578)
19/10/2023	GBP	325	USD	403	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
19/10/2023	SGD	2.000	USD	1.464	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
19/10/2023	USD	2.625	GBP	2.116	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	41
19/10/2023	SGD	1.168	USD	858	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
19/10/2023	GBP	12.655	USD	15.358	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	90
19/10/2023	GBP	11.480	USD	14.006	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
19/10/2023	GBP	1.130	USD	1.379	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
19/10/2023	EUR	6.990	USD	7.517	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(110)
19/10/2023	GBP	7.342	USD	9.172	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(210)
19/10/2023	SGD	7.800	USD	5.740	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20)
19/10/2023	GBP	15.073	USD	18.490	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(90)
19/10/2023	EUR	10.099	USD	10.623	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	78
19/10/2023	USD	761	GBP	614	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12
							(1.648.343) USD

Notas a los estados financieros

(continuación)

10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de incumplimiento crediticio:

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado en la divisa base de la Cartera	% del patrimonio neto
CDS	JPMorgan	Airbus SE	Venta	EUR	1.300.000	20/06/2025	13.760	0,00
CDS	JPMorgan	Glencore International	Venta	EUR	1.100.000	20/06/2026	123.843	0,01
CDS	Goldman Sachs	Anglo American plc	Venta	EUR	1.770.000	20/12/2026	230.310	0,02
CDS	Citigroup Global Markets	Lloyds Banking Group	Compra	EUR	4.650.000	20/06/2027	38.440	0,00
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Compra	EUR	580.000	20/12/2023	(3.644)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Compra	EUR	200.000	20/12/2023	(1.257)	(0,00)
CDS	Barclays	Swedbank AB	Compra	EUR	3.910.000	20/06/2028	(64.428)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Standard Chartered plc	Compra	EUR	7.880.000	20/06/2028	(72.740)	(0,01)
CDS	Goldman Sachs	Telia Co AB	Compra	EUR	4.000.000	20/06/2028	(98.603)	(0,01)
CDS	Goldman Sachs	Veolia Environment	Compra	EUR	3.000.000	20/06/2028	(72.078)	(0,01)
CDS	Bank of America Merrill Lynch	Banco Bilbao Vizcaya	Compra	EUR	3.990.000	20/06/2028	(5.904)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.40	Compra	USD	15.000.000	20/06/2028	(201.718)	(0,02)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.40	Compra	USD	80.000.000	20/06/2028	(1.075.832)	(0,11)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	40.000.000	20/06/2028	(494.992)	(0,05)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.40	Venta	USD	7.500.000	20/06/2028	100.859	0,01
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.40	Venta	USD	6.000.000	20/06/2028	80.687	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	2.000.000	20/06/2028	24.750	0,00
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.40	Venta	USD	3.000.000	20/06/2028	40.344	0,00
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.40	Compra	USD	78.500.000	20/06/2028	(1.055.660)	(0,11)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.40	Venta	USD	78.500.000	20/06/2028	1.055.660	0,11
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	38.000.000	20/06/2028	(470.241)	(0,05)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	38.000.000	20/06/2028	470.242	0,05
							(1.438.202) USD	(0,17)

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de incumplimiento crediticio:

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado en la divisa base de la Cartera	% del patrimonio neto
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	1.700.000	20/06/2028	(19.869)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	11.680.000	20/06/2028	(136.517)	(0,18)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	11.980.000	20/06/2028	(140.024)	(0,18)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	2.170.652	20/06/2028	(110.313)	(0,14)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	2.338.384	20/06/2028	(118.838)	(0,15)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	11.680.000	20/06/2028	136.517	0,18
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	167.732	20/06/2028	8.524	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	2.170.652	20/06/2028	110.313	0,14
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	2.000.000	20/06/2028	23.376	0,03
CDS	JPMorgan	Glencore International	Venta	EUR	400.000	20/06/2026	42.535	0,06
CDS	JPMorgan	Commerzbank	Venta	EUR	600.000	20/06/2027	6.429	0,01

Notas a los estados financieros

(continuación)

10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

(continuación)

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado en la divisa base de la Cartera	% del patrimonio neto
CDS	Goldman Sachs	Airbus SE	Venta	EUR	600.000	20/06/2027	8.048	0,01
							(189.819) EUR	(0,24)

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de incumplimiento crediticio:

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado en la divisa base de la Cartera	% del patrimonio neto
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Compra	EUR	325.000	20/12/2023	(1.929)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Airbus SE	Venta	EUR	900.000	20/06/2025	8.998	0,01
CDS	JPMorgan	Glencore International	Venta	EUR	600.000	20/06/2026	63.803	0,05
CDS	Citigroup Global Markets	Lloyds Banking Group	Compra	EUR	1.700.000	20/06/2027	13.274	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	3.250.000	20/06/2028	68.589	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	11.760.987	20/06/2028	(597.699)	(0,47)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	138.132	20/06/2028	7.020	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	739.995	20/06/2028	37.607	0,03
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	394.664	20/06/2028	20.057	0,02
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	468.664	20/06/2028	23.818	0,02
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	448.930	20/06/2028	22.815	0,02
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	394.664	20/06/2028	20.057	0,02
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	1.381.324	20/06/2028	70.199	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	7.794.614	20/06/2028	(396.126)	(0,31)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	3.250.000	20/06/2028	68.589	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	7.794.614	20/06/2028	396.126	0,31
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	3.250.000	20/06/2028	(68.589)	(0,05)
CDS	Barclays	Swedbank AB	Compra	EUR	1.670.000	20/06/2028	(25.991)	(0,02)
CDS	JPMorgan	Standard Chartered plc	Compra	EUR	2.020.000	20/06/2028	(17.612)	(0,01)
CDS	Barclays	Mercedes-Benz Group	Compra	EUR	537.500	20/06/2028	(7.632)	(0,01)
CDS	Goldman Sachs	Telia Co AB	Compra	EUR	1.700.000	20/06/2028	(39.581)	(0,03)
CDS	Goldman Sachs	Veolia Environment	Compra	EUR	1.750.000	20/06/2028	(39.713)	(0,03)
CDS	Bank of America Merrill Lynch	Banco Bilbao Vizcaya	Compra	EUR	950.000	20/06/2028	(1.328)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Coöperatieve Rabobank U.A.	Compra	EUR	600.000	20/06/2028	5.033	0,00
CDS	JPMorgan	Forvia SE	Venta	EUR	480.000	20/12/2028	36.711	0,03
CDS	Citigroup Global Markets	Ford MOTOR COMPANY	Venta	USD	1.000.000	20/12/2028	97.843	0,08
CDS	JPMorgan	Valeo SE	Venta	EUR	700.000	20/12/2028	(56.070)	(0,04)
CDS	Goldman Sachs	Jaguar Land Rover Automotive Plc	Venta	EUR	800.000	20/12/2028	(33.206)	(0,03)
							(324.937) EUR	(0,24)

Notas a los estados financieros

(continuación)

10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

(continuación)

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de incumplimiento crediticio:

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado en la divisa base de la Cartera	% del patrimonio neto
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.40	Venta	USD	3.340.000	20/06/2028	44.916	0,14
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	2.052.253	20/06/2028	110.424	0,35
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.40	Venta	USD	3.340.000	20/06/2028	44.916	0,14
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.40	Compra	USD	3.340.000	20/06/2028	(44.916)	(0,14)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	2.052.253	20/06/2028	(110.424)	(0,35)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	2.052.253	20/06/2028	110.424	0,35
							155.340 USD	0,49

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de incumplimiento crediticio:

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado en la divisa base de la Cartera	% del patrimonio neto
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	555.467	20/06/2028	6.874	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	400.000	20/06/2028	(4.950)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	400.000	20/06/2028	(4.950)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	150.000	20/06/2028	1.856	0,00
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	197.332	20/06/2028	10.618	0,01
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.40	Compra	USD	1.000.000	20/06/2028	(13.448)	(0,01)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	100.000	20/12/2023	(1.127)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Anglo American plc	Venta	EUR	40.000	20/12/2026	5.205	0,01
CDS	JPMorgan	Standard Chartered plc	Compra	EUR	110.000	20/06/2028	(1.015)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Veolia Environment	Compra	EUR	70.000	20/06/2028	(1.682)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Telia Co AB	Compra	EUR	90.000	20/06/2028	(2.219)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	70.000	20/06/2028	866	0,00
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	197.332	20/06/2028	(10.618)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	555.467	20/06/2028	(6.874)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	555.467	20/06/2028	6.874	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	986.660	20/06/2028	(53.088)	(0,05)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.40	Compra	USD	1.000.000	20/06/2028	(13.448)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.40	Venta	USD	1.000.000	20/06/2028	13.448	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	986.660	20/06/2028	53.088	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	986.660	20/06/2028	(53.088)	(0,05)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	986.660	20/06/2028	53.088	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	580.000	20/06/2028	(7.177)	(0,01)

Notas a los estados financieros

(continuación)

10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

(continuación)

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado en la divisa base de la Cartera	% del patrimonio neto
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	580.000	20/06/2028	7.178	0,01
							(14.589) USD	(0,01)

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de incumplimiento crediticio:

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado en la divisa base de la Cartera	% del patrimonio neto
CDS	Goldman Sachs	Arcelormittal	Compra	EUR	7.500.000	20/12/2023	(77.469)	(0,03)
CDS	JPMorgan	Airbus SE	Venta	EUR	3.950.000	20/06/2025	39.489	0,02
CDS	Goldman Sachs	Anglo American plc	Venta	EUR	4.000.000	20/12/2026	491.593	0,22
CDS	BNP Paribas	British Telecommunications plc	Compra	EUR	15.000.000	20/06/2027	(158.652)	(0,07)
CDS	Citigroup Global Markets	Lloyds Banking Group	Compra	EUR	6.660.000	20/06/2027	52.001	0,02
CDS	Goldman Sachs	Lloyds Banking Group	Compra	EUR	4.430.000	20/12/2027	(35.289)	(0,02)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	117.570.406	20/06/2028	(5.974.980)	(2,69)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	14.470.000	20/06/2028	(102.283)	(0,05)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.40	Compra	USD	96.650.000	20/06/2028	(1.227.616)	(0,55)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	3.650.000	20/06/2028	(25.801)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	6.215.958	20/06/2028	315.898	0,14
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	13.300.000	20/06/2028	155.452	0,07
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	7.600.000	20/06/2028	160.393	0,07
CDS	Barclays	Swedbank AB	Compra	EUR	9.190.000	20/06/2028	(143.027)	(0,06)
CDS	JPMorgan	Standard Chartered plc	Compra	EUR	4.760.000	20/06/2028	(41.501)	(0,02)
CDS	Citigroup Global Markets	Tesco plc	Compra	EUR	5.000.000	20/06/2028	(37.358)	(0,02)
CDS	Goldman Sachs	Telia Co AB	Compra	EUR	5.000.000	20/06/2028	(116.414)	(0,05)
CDS	Barclays	Mercedes-Benz Group	Compra	EUR	10.000.000	20/06/2028	(142.000)	(0,06)
CDS	Citigroup Global Markets	Bayerische Motoren Werke AG	Compra	EUR	8.000.000	20/06/2028	(113.868)	(0,05)
CDS	Goldman Sachs	Veolia Environment	Compra	EUR	5.000.000	20/06/2028	(113.465)	(0,05)
CDS	Citigroup Global Markets	Westpac banking Corp.	Compra	USD	12.050.000	20/06/2028	(234.545)	(0,11)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.40	Venta	USD	5.000.000	20/06/2028	63.508	0,03
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	1.775.988	20/06/2028	90.257	0,04
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	4.000.000	20/06/2028	46.752	0,02
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	23.100.000	20/06/2028	269.996	0,12
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	2.170.652	20/06/2028	110.313	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	8.189.278	20/06/2028	416.183	0,19
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	9.570.602	20/06/2028	486.382	0,22

Notas a los estados financieros

(continuación)

10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

(continuación)

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado en la divisa base de la Cartera	% del patrimonio neto
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	5.525.296	20/06/2028	280.798	0,13
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	1.677.322	20/06/2028	85.242	0,04
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	4.933.300	20/06/2028	250.713	0,11
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.40	Venta	USD	18.540.000	20/06/2028	235.489	0,11
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	2.500.000	20/06/2028	(52.761)	(0,02)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	3.600.000	20/06/2028	42.077	0,02
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.40	Venta	USD	2.600.000	20/06/2028	33.025	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	3.600.000	20/06/2028	25.447	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	1.351.724	20/06/2028	68.695	0,03
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	4.933.300	20/06/2028	250.713	0,11
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	3.354.644	20/06/2028	170.485	0,08
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	44.000.000	20/06/2028	514.277	0,23
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	64.517.697	20/06/2028	(3.278.818)	(1,48)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.40	Compra	USD	70.510.000	20/06/2028	(895.595)	(0,40)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.40	Venta	USD	70.510.000	20/06/2028	895.595	0,40
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	14.520.000	20/06/2028	(102.636)	(0,05)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	5.100.000	20/06/2028	107.632	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	64.517.697	20/06/2028	3.278.818	1,48
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	44.000.000	20/06/2028	(514.277)	(0,23)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	5.100.000	20/06/2028	(107.632)	(0,05)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	14.520.000	20/06/2028	102.636	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	6.896.753	20/06/2028	350.496	0,16
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	591.996	20/06/2028	30.086	0,01
CDS	Bank of America Merrill Lynch	Banco Bilbao Vizcaya	Compra	EUR	7.500.000	20/06/2028	(10.482)	(0,00)
CDS	Citigroup Global Markets	BNP Paribas SA	Compra	EUR	5.380.000	20/06/2028	42.271	0,02
CDS	Citigroup Global Markets	HSBC Holdings	Compra	EUR	6.300.000	20/06/2028	51.538	0,02
CDS	Goldman Sachs	ING Groep NV	Compra	EUR	6.170.000	20/06/2028	78.632	0,04
CDS	Goldman Sachs	Coöperatieve Rabobank U.A.	Compra	EUR	5.610.000	20/06/2028	47.058	0,02
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	3.354.644	20/06/2028	170.485	0,08
CDS	Citigroup Global Markets	Ford Motor Company	Venta	USD	1.700.000	20/12/2028	166.334	0,07
CDS	JPMorgan	Forvia SE	Venta	EUR	840.000	20/12/2028	64.245	0,03
CDS	JPMorgan	Valeo SE	Venta	EUR	1.600.000	20/12/2028	(128.161)	(0,06)

Notas a los estados financieros

(continuación)

10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

(continuación)

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado en la divisa base de la Cartera	% del patrimonio neto
CDS	JPMorgan	Unicredit SPA	Compra	EUR	2.400.000	20/12/2028	1.168	0,00
CDS	Goldman Sachs	Jaguar Land Rover Automotive Plc	Venta	EUR	1.800.000	20/12/2028	(74.716)	(0,03)
							(3.667.174) EUR	(1,64)

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de incumplimiento crediticio:

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado en la divisa base de la Cartera	% del patrimonio neto
CDS	JPMorgan	Airbus SE	Venta	EUR	350.000	20/06/2025	3.499	0,04
CDS	Goldman Sachs	Anglo American plc	Venta	EUR	190.000	20/12/2026	23.351	0,28
CDS	Citigroup Global Markets	Lloyds Banking Group	Compra	EUR	600.000	20/06/2027	4.685	0,06
CDS	JPMorgan	United Utilities Group	Compra	EUR	80.000	20/12/2023	(159)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Lloyds Banking Group	Compra	EUR	130.000	20/12/2027	(1.036)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Compra	EUR	145.000	20/12/2023	(861)	(0,01)
CDS	Barclays	Tesco plc	Compra	EUR	100.000	20/12/2023	(189)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Tesco plc	Compra	EUR	260.000	20/12/2023	(491)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Compra	EUR	250.000	20/12/2023	(1.484)	(0,02)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	1.460.257	20/06/2028	(74.211)	(0,89)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	490.000	20/06/2028	(3.464)	(0,04)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.40	Compra	USD	4.840.000	20/06/2028	(61.476)	(0,74)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	1.400.000	20/06/2028	29.546	0,36
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	100.000	20/06/2028	2.110	0,03
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.40	Venta	USD	1.030.000	20/06/2028	13.083	0,16
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	790.000	20/06/2028	9.234	0,11
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.40	Venta	USD	300.000	20/06/2028	3.810	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	600.000	20/06/2028	7.013	0,08
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	1.020.000	20/06/2028	11.922	0,14
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	360.000	20/06/2028	4.208	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	700.000	20/06/2028	(4.948)	(0,06)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	600.000	20/06/2028	(7.013)	(0,08)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.40	Venta	USD	880.000	20/06/2028	11.177	0,13
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	69.066	20/06/2028	3.510	0,04
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	760.000	20/06/2028	(8.883)	(0,11)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.40	Compra	USD	2.630.000	20/06/2028	(33.405)	(0,40)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.40	Venta	USD	2.630.000	20/06/2028	33.405	0,40
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	1.190.000	20/06/2028	(8.412)	(0,10)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	1.500.000	20/06/2028	31.657	0,38

Notas a los estados financieros

(continuación)

10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

(continuación)

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado en la divisa base de la Cartera	% del patrimonio neto
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	1.391.191	20/06/2028	70.701	0,85
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	1.410.000	20/06/2028	(16.480)	(0,20)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	1.410.000	20/06/2028	16.480	0,20
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	1.500.000	20/06/2028	(31.657)	(0,38)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	1.391.191	20/06/2028	(70.701)	(0,85)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	1.190.000	20/06/2028	8.412	0,10
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.40	Venta	USD	290.000	20/06/2028	3.684	0,04
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	170.000	20/06/2028	(3.588)	(0,04)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	110.000	20/06/2028	778	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	157.866	20/06/2028	8.023	0,10
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Compra	EUR	320.000	20/06/2028	(3.740)	(0,05)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Venta	EUR	39.466	20/06/2028	2.006	0,02
CDS	Barclays	Swedbank AB	Compra	EUR	780.000	20/06/2028	(12.139)	(0,15)
CDS	JPMorgan	Standard Chartered plc	Compra	EUR	300.000	20/06/2028	(2.616)	(0,03)
CDS	Barclays	Mercedes-Benz Group	Compra	EUR	400.000	20/06/2028	(5.680)	(0,07)
CDS	Citigroup Global Markets	Bayerische Motoren Werke AG	Compra	EUR	350.000	20/06/2028	(4.982)	(0,06)
CDS	Citigroup Global Markets	Tesco plc	Compra	EUR	150.000	20/06/2028	(1.121)	(0,01)
CDS	Goldman Sachs	Telia Co AB	Compra	EUR	250.000	20/06/2028	(5.821)	(0,07)
CDS	Goldman Sachs	Natural Energy Group SA	Compra	EUR	130.000	20/06/2028	(1.936)	(0,02)
CDS	Goldman Sachs	Veolia Environment	Compra	EUR	480.000	20/06/2028	(10.893)	(0,13)
CDS	Citigroup Global Markets	Westpac banking Corp.	Compra	USD	820.000	20/06/2028	(15.961)	(0,19)
CDS	Bank of America Merrill Lynch	Banco Bilbao Vizcaya	Compra	EUR	640.000	20/06/2028	(894)	(0,01)
CDS	Citigroup Global Markets	BNP Paribas SA	Compra	EUR	450.000	20/06/2028	3.536	0,04
CDS	Citigroup Global Markets	HSBC Holdings	Compra	EUR	380.000	20/06/2028	3.109	0,04
CDS	Goldman Sachs	ING Groep NV	Compra	EUR	290.000	20/06/2028	3.696	0,04
CDS	Goldman Sachs	Coöperatieve Rabobank U.A.	Compra	EUR	330.000	20/06/2028	2.769	0,03
							(78.837) EUR	(0,95)

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de rentabilidad total:

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Pagar/Recibir	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera	% del patrimonio neto
SRT	Goldman Sachs	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 3 acciones y recibe 1M EURIBOR.	EUR	430.247	del 05/05/2027 al 24/10/2029	9.634	0,02

Notas a los estados financieros

(continuación)

10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

(continuación)

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Pagar/Recibir	Divisa	Importe nominal	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera	% del patrimonio neto
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 8 acciones y recibe CHF SARON 1M.	CHF	2.905.639	07/02/2024	8.955	0,02
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 8 acciones y recibe 1M CIBOR.	DKK	35.863.076	07/02/2024	25.854	0,06
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 36 acciones y recibe 1M EURIBOR.	EUR	10.240.579	07/02/2024	(22.191)	(0,05)
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 2 acciones y recibe 1M NIBOR.	NOK	3.514.976	07/02/2024	(429)	(0,00)
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la acción subyacente y recibe 1M SONIA.	GBP	111.071	06/12/2024	1.894	0,00
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 12 acciones y recibe 1M STIBOR.	SEK	26.774.261	07/02/2024	(10.394)	(0,02)
							13.323 EUR	0,03

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de rentabilidad total:

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Pagar/Recibir	Divisa	Importe nominal	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera	% del patrimonio neto
SRT	Bank of America Merrill Lynch	North America Equity Basket	Paga SOFR y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 2 acciones. Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 8 acciones y recibe SOFR.	USD	3.248.069	21/10/2024	41.209	0,08
SRT	UBS	North America Equity Basket	Paga SOFR y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 4 acciones. Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 36 acciones y recibe SOFR.	USD	13.720.534	25/06/2025	1.175	0,00
							42.384 USD	0,08

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de rentabilidad total:

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Pagar/Recibir	Divisa	Importe nominal	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera	% del patrimonio neto
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la acción subyacente y recibe AUD SWAP OIS 1M.	AUD	1.520.829	10/01/2025	21.605	0,03

Notas a los estados financieros

(continuación)

10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

(continuación)

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Pagar/Recibir	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera	% del patrimonio neto
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga 1M CDOR y recibe el rendimiento de la acción subyacente.	CAD	783.650	03/06/2024	(23.980)	(0,03)
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga CHF SARON 1M y recibe el rendimiento de la acción subyacente.	CHF	1.344.989	04/11/2024	0	0,00
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga 1M EURIBOR y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 5 acciones. Paga el rendimiento de la acción subyacente y recibe 1M EURIBOR.	EUR	3.724.555	10/01/2025 a 06/05/2026	52.236	0,06
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 2 acciones y recibe 1M SONIA.	GBP	1.348.567	10/01/2025	23.913	0,03
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga SOFR y recibe el rendimiento de la acción subyacente.	IDR	11.377.125.000	02/02/2026	(52.345)	(0,06)
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga 1M-TIBOR y recibe el rendimiento de la acción subyacente. Paga el rendimiento de la acción subyacente y recibe 1M-TIBOR.	JPY	273.691.800	03/06/2024	37.172	0,05
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga 1M STIBOR y recibe el rendimiento de la acción subyacente. Paga el rendimiento de la acción subyacente y recibe 1M STIBOR.	SEK	18.667.454	10/01/2025	51.447	0,06
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga SOFR y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 22 acciones. Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 16 acciones y recibe SOFR.	USD	46.509.135	10/01/2025	(543.492)	(0,67)
							(433.444) USD	(0,53)

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de rentabilidad total:

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Pagar/Recibir	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera	% del patrimonio neto
SRT	Goldman Sachs	North America Commodities Basket	Paga el 0,11% y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 2 índices. Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 4 índices y recibe el 0,11%.	USD	84.493.325	02/10/2023	(2.192.932)	(1,26)

Notas a los estados financieros

(continuación)

10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

(continuación)

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Pagar/Recibir	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera	% del patrimonio neto
SRT	JPMorgan	North America Commodities Basket	Paga del 0% al 0,58% y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 29 índices. Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 21 índices y recibe el 0%.	USD	294.796.058	02/10/2023	(1.701.275)	(0,98)
SRT	Macquarie	North America Commodities Basket	Paga el 0,17% y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 4 índices. Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 2 índices y recibe el 0,17%.	USD	49.656.639	02/10/2023	(1.103.707)	(0,63)
							(4.997.914) USD	(2,87)

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

A 30 de septiembre de 2023, la contraparte de los contratos de futuros pendientes es UBS.

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la Cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera	% del patrimonio neto
Euro-Bobl Future	Ventas	(140)	EUR	(14.557.029)	07/12/2023	201.586	0,02
Euro-OAT Future	Ventas	(58)	EUR	(5.948.176)	07/12/2023	198.346	0,02
Euro-Bund Future	Ventas	(131)	EUR	(12.709.986)	07/12/2023	360.695	0,04
Japan 10Y Bond	Ventas	(14)	JPY	(9.088.812)	13/12/2023	109.767	0,01
Canada 10Y Bond	Compras	143	CAD	8.712.952	18/12/2023	(216.385)	(0,02)
Ultra 10Y US Treasury Note	Ventas	(454)	USD	(41.349.469)	19/12/2023	1.149.230	0,12
10Y US Treasury Note	Compras	158	USD	15.382.781	19/12/2023	(328.340)	(0,03)
US Treasury Note	Compras	4	USD	389.875	19/12/2023	(26.063)	(0,00)
Ultra US Treasury Bond Future	Ventas	(79)	USD	(5.810.203)	19/12/2023	663.589	0,07
Long Gilt Future	Ventas	(134)	GBP	(10.502.274)	27/12/2023	(45.449)	(0,00)
2Y US Treasury Note	Compras	48	USD	9.595.875	29/12/2023	(32.998)	(0,00)
5Y US Treasury Note	Compras	472	USD	46.071.625	29/12/2023	(494.987)	(0,05)
						1.538.991 USD	0,18

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la Cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera	% del patrimonio neto
Euro-Bobl Future	Compras	40	EUR	3.928.360	07/12/2023	(49.250)	(0,06)
Euro-Bund Future	Ventas	(11)	EUR	(1.008.029)	07/12/2023	13.890	0,02
Ultra 10Y US Treasury Note	Ventas	(15)	USD	(1.290.363)	19/12/2023	44.016	0,06
10Y US Treasury Note	Ventas	(12)	USD	(1.103.483)	19/12/2023	23.465	0,03
US Treasury Note	Ventas	(3)	USD	(276.180)	19/12/2023	18.440	0,02

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la Cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera	% del patrimonio neto
Long Gilt Future	Ventas	(4)	GBP	(296.105)	27/12/2023	(6)	(0,00)
						50.555 EUR	0,07

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la Cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera	% del patrimonio neto
10Y US Treasury Note	Ventas	(12)	USD	(1.103.483)	19/12/2023	20.898	0,01
						20.898 EUR	0,01

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - European Social Bond tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la Cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera	% del patrimonio neto
Long-Term Euro-BTP Future	Ventas	(4)	EUR	(388.620)	07/12/2023	18.520	0,00
Euro-Bund Future	Ventas	(118)	EUR	(10.813.402)	07/12/2023	281.380	0,07
Short-Term Euro-BTP Future	Ventas	(1)	EUR	(99.123)	07/12/2023	770	0,00
10Y US Treasury Note	Ventas	(33)	USD	(3.034.578)	19/12/2023	64.529	0,02
Long Gilt Future	Ventas	(149)	GBP	(11.029.895)	27/12/2023	(859)	(0,00)
2Y US Treasury Note	Ventas	(3)	USD	(566.462)	29/12/2023	1.926	0,00
5Y US Treasury Note	Ventas	(30)	USD	(2.765.791)	29/12/2023	26.344	0,01
						392.610 EUR	0,10

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la Cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera	% del patrimonio neto
Euro-Schatz Future	Ventas	(3)	EUR	(299.349)	07/12/2023	1.335	0,00
Euro-Bobl Future	Ventas	(136)	EUR	(13.356.424)	07/12/2023	178.860	0,14
Euro-Buxl Future	Ventas	(29)	EUR	(2.030.928)	07/12/2023	273.760	0,21
Euro-Bund Future	Compras	181	EUR	16.586.659	07/12/2023	(541.594)	(0,42)
Japan 10Y Bond	Ventas	(15)	JPY	(9.197.651)	13/12/2023	104.436	0,08
Ultra 10Y US Treasury Note	Compras	14	USD	1.204.339	19/12/2023	(44.097)	(0,03)
10Y US Treasury Note	Compras	43	USD	3.954.147	19/12/2023	(125.014)	(0,10)
US Treasury Note	Ventas	(24)	USD	(2.209.445)	19/12/2023	147.522	0,12
Ultra US Treasury Bond Future	Ventas	(44)	USD	(3.056.494)	19/12/2023	382.089	0,30
Long Gilt Future	Ventas	(30)	GBP	(2.220.784)	27/12/2023	(29.032)	(0,02)
5Y US Treasury Note	Ventas	(33)	USD	(3.042.370)	29/12/2023	22.086	0,02
						370.351 EUR	0,30

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la Cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera	% del patrimonio neto
10Y US Treasury Note	Ventas	(38)	USD	(3.699.656)	19/12/2023	71.843	0,13
5Y US Treasury Note	Compras	87	USD	8.492.016	29/12/2023	(73.404)	(0,14)
						(1.561) USD	(0,01)

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la Cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera	% del patrimonio neto
Topix Index Future	Compras	9	JPY	1.401.340	07/12/2023	9.409	0,03
E-mini S&P 500	Ventas	(21)	USD	(4.541.775)	15/12/2023	195.037	0,62
Euro Stoxx 50	Ventas	(37)	EUR	(1.646.864)	15/12/2023	33.494	0,11
FTSE 100 Index Future	Compras	7	GBP	655.399	15/12/2023	10.466	0,03
						248.406 USD	0,79

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la Cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera	% del patrimonio neto
Euro-Bobl Future	Ventas	(4)	EUR	(415.915)	07/12/2023	3.674	0,00
Euro-OAT Future	Ventas	(1)	EUR	(102.555)	07/12/2023	3.420	0,00
E-mini S&P 500	Compras	3	USD	648.825	15/12/2023	(27.929)	(0,03)
Euro Stoxx 50	Compras	3	EUR	133.530	15/12/2023	(2.700)	(0,00)
FTSE 100 Index Future	Compras	4	GBP	374.514	15/12/2023	5.981	0,01
E-Mini RUSS 1000 V	Ventas	(161)	USD	(12.137.790)	15/12/2023	427.053	0,44
E-Mini RUSS 1000 G	Compras	91	USD	12.320.945	15/12/2023	(591.728)	(0,60)
Canada 10Y Bond	Compras	2	CAD	121.859	18/12/2023	(2.975)	(0,00)
10Y US Treasury Note	Compras	2	USD	194.719	19/12/2023	(5.063)	(0,01)
Long Gilt Future	Ventas	(3)	GBP	(235.126)	27/12/2023	(18)	(0,00)
5Y US Treasury Note	Compras	5	USD	488.047	29/12/2023	(3.649)	(0,00)
						(193.934) USD	(0,19)

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la Cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera	% del patrimonio neto
Euro-Schatz Future	Compras	273	EUR	27.240.759	07/12/2023	(118.755)	(0,05)
Euro-Bobl Future	Ventas	(448)	EUR	(43.997.632)	07/12/2023	594.471	0,27
Euro-OAT Future	Ventas	(63)	EUR	(6.102.432)	07/12/2023	203.490	0,09
Euro-Bund Future	Ventas	(130)	EUR	(11.913.070)	07/12/2023	361.460	0,16
Japan 10Y Bond	Ventas	(26)	JPY	(15.942.595)	13/12/2023	192.541	0,09
Ultra 10Y US Treasury Note	Compras	4	USD	344.097	19/12/2023	(12.574)	(0,01)
10Y US Treasury Note	Compras	79	USD	7.264.596	19/12/2023	(155.060)	(0,07)

Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la Cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera	% del patrimonio neto
Ultra US Treasury Bond Future	Ventas	(10)	USD	(694.658)	19/12/2023	86.837	0,04
Long Gilt Future	Ventas	(87)	GBP	(6.440.274)	27/12/2023	(9.535)	(0,00)
5Y US Treasury Note	Compras	248	USD	22.863.872	29/12/2023	(237.925)	(0,11)
						904.950 EUR	0,41

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Fund tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la Cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera	% del patrimonio neto
Euro-Schatz Future	Compras	17	EUR	1.696.311	07/12/2023	(7.395)	(0,09)
Euro-Bobl Future	Ventas	(13)	EUR	(1.276.717)	07/12/2023	14.030	0,17
Euro-OAT Future	Ventas	(3)	EUR	(290.592)	07/12/2023	9.690	0,12
Euro-Bund Future	Ventas	(13)	EUR	(1.191.307)	07/12/2023	35.020	0,42
Japan 10Y Bond	Ventas	(1)	JPY	(613.177)	13/12/2023	7.405	0,09
Ultra 10Y US Treasury Note	Ventas	(3)	USD	(258.072)	19/12/2023	9.364	0,11
10Y US Treasury Note	Compras	7	USD	643.699	19/12/2023	(13.179)	(0,16)
Ultra US Treasury Bond Future	Ventas	(1)	USD	(69.466)	19/12/2023	8.684	0,10
Long Gilt Future	Ventas	(2)	GBP	(148.052)	27/12/2023	(1.517)	(0,02)
5Y US Treasury Note	Compras	4	USD	368.773	29/12/2023	(2.841)	(0,03)
						59.261 EUR	0,71

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la Cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la Cartera	% del patrimonio neto
Euro Stoxx 50	Ventas	(261)	EUR	(10.972.440)	15/12/2023	78.695	0,17
						78.695 EUR	0,17

12 OPCIONES AL VALOR DE MERCADO

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income tenía pendientes las siguientes opciones:

Descripción	Contraparte	Precio de ejercicio	Divisa	Contratos	Fecha de vencimiento	Compromiso en la divisa base de la Cartera	Valor de mercado en la divisa base de la Cartera	% del patrimonio neto
Opciones sobre futuros								
Call S&P 500 Index	UBS	4.595,000	USD	(40)	13/10/2023	154.789*	(760)	(0,00)
Call FTSE 100 Index	UBS	7.875,000	GBP	(22)	20/10/2023	363.543*	(4.699)	(0,00)
Call Euro Stoxx 50	UBS	4.400,000	EUR	(54)	20/10/2023	240.791*	(2.287)	(0,00)
						(7.746) USD	(0,00)	

* El compromiso en posiciones cortas de compra es ilimitado.

Notas a los estados financieros

(continuación)

13 AGRUPACIÓN

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

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

A 30 de septiembre de 2023, la SICAV no tenía una agrupación de activos. Sin embargo, Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return Portfolio, para fines de gestión de inversiones, se divide por clases de activos en diversas cestas que solo ella posee.

14 CAMBIOS EN LA COMPOSICIÓN DE ESTADOS DE LA CARTERA

Los cambios en los Estados de la Cartera están disponibles para los Accionistas previa solicitud y de forma gratuita en el domicilio social de la SICAV.

15 AJUSTE DE DILUCIÓN

Las Carteras pueden sufrir una reducción del Valor liquidativo por Acción debido a los diferenciales de negociación, los costes operativos y las tasas impositivas que surgen cuando las compras y las ventas de inversiones subyacentes las realiza el Subasesor para acomodar las entradas de efectivo y las salidas de capital, lo que se conoce como «dilución». Se podrá aplicar un ajuste de dilución para proteger a los Accionistas de las Carteras contrarrestando el impacto de la dilución (el «Ajuste de dilución»). Si la actividad neta de capital (incluidas suscripciones, reembolsos y conversiones en una Cartera determinada) en una Fecha de valoración determinada supera el umbral establecido ocasionalmente por la Sociedad Gestora para dicha Cartera, el Valor liquidativo de la Cartera podrá ajustarse al alza o a la baja para reflejar las entradas netas y las salidas netas, respectivamente.

El Valor liquidativo por Acción de cada Clase de Acciones de la Cartera se calcula por separado, pero cualquier Ajuste de dilución tendrá un efecto idéntico en el Valor liquidativo por Acción de cada Clase de Acciones de la Cartera. La Sociedad Gestora establecerá el importe del Ajuste de dilución para reflejar los diferenciales de negociación, los costes operativos y los impuestos estimados en los que pueda incurrir la Cartera; estos costes pueden variar en función de las condiciones del mercado y la composición de la Cartera. Por lo tanto, el Ajuste de dilución puede modificarse ocasionalmente. Dichos Ajustes de dilución podrán variar de Cartera a Cartera y entre las entradas y salidas de capital diarias netas, pero no superarán el 2% del Valor liquidativo por Acción original. Se realiza una revisión periódica para verificar la idoneidad de los Ajustes de dilución que se están aplicando. En el curso habitual de las actividades, la aplicación del Ajuste de dilución se activará de forma mecánica y coherente. Sin embargo, la Sociedad Gestora se reserva el derecho de realizar un Ajuste discrecional de la dilución si, en su opinión, dicha acción redundaría en el interés de los Accionistas existentes, incluso en circunstancias excepcionales. Estas circunstancias excepcionales incluyen, entre otros, periodos de elevada volatilidad del mercado y periodos de baja liquidez del mercado.

Se podrá aplicar un Ajuste de dilución en todas las Carteras con la excepción de Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities Portfolio.

En el sitio web www.columbiathreadneedle.com se publican las estimaciones del importe del Ajuste de dilución basado en los valores de cada Cartera y las condiciones de mercado en el momento de la emisión del Folleto, en septiembre de 2023.

A 30 de septiembre de 2023, no se ha aplicado ningún Ajuste de dilución.

16 COSTES OPERATIVOS

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

Carteras	Divisa	Costes operativos
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond ¹	USD	n/d
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond ¹	EUR	n/d
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond ¹	EUR	n/d
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond ¹	EUR	n/d
Threadneedle (Lux) - European Social Bond ¹	EUR	n/d
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond ¹	EUR	n/d
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds ¹	USD	n/d
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt ¹	USD	n/d
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds ¹	USD	n/d
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond ¹	USD	n/d
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond ¹	USD	n/d
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return ²	EUR	33
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	USD	5.612

Notas a los estados financieros

(continuación)

16 COSTES OPERATIVOS

(continuación)

Carteras	Divisa	Costes operativos
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	USD	19.025
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities ²	USD	8.780
Threadneedle (Lux) - Global Focus	USD	1.197.158
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	USD	306.471
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	USD	45.845
Threadneedle (Lux) - Global Select	USD	189.523
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	EUR	634.078
Threadneedle (Lux) - American	USD	126.726
Threadneedle (Lux) - American Select	USD	51.968
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	USD	190.805
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	USD	67.131
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	USD	137.947
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	USD	38.969
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	USD	13.687
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	EUR	272.510
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	EUR	62.049
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	EUR	107.436
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	EUR	221.443
Threadneedle (Lux) - European Select	EUR	312.682
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	EUR	370.177
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	USD	93.004
Threadneedle (Lux) - Global Technology	USD	100.124
Threadneedle (Lux) - UK Equities	GBP	118.921
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	GBP	202.112
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha ²	USD	5.580
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities ¹	EUR	n/d
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities ¹	EUR	n/d
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	EUR	103.458
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	USD	18.644
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	USD	51.759
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities ¹	USD	n/d

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

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

² Consulte la nota 1.

17 INFORMACIÓN SOBRE GARANTÍAS

La siguiente tabla muestra los saldos de garantía en efectivo recibidos y pagados por las Carteras a 30 de septiembre de 2023:

Carteras	Contraparte	Tipo de inversión	Divisa	Garantía en efectivo
Garantía recibida por la Cartera				
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	JPM Securities	Contratos a plazo y swaps	USD	11.610.000
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	Citigroup Global Markets	Contratos a plazo y swaps	USD	80.000
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	Goldman Sachs	Contratos a plazo y swaps	USD	10.000
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	NatWest Markets	Contratos a plazo	EUR	650.000
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	Citigroup Global Markets	Contratos a plazo	EUR	120.000
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	Citigroup Global Markets	Contratos a plazo	EUR	160.000

Notas a los estados financieros

(continuación)

17 INFORMACIÓN SOBRE GARANTÍAS

(continuación)

Carteras	Contraparte	Tipo de inversión	Divisa	Garantía en efectivo
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	Citigroup Global Markets	Swaps	EUR	10.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	Barclays	Contratos a plazo y swaps	USD	470.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	Lloyds	Contratos a plazo	USD	260.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	Citigroup Global Markets	Contratos a plazo	USD	130.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	JPM Securities	Contratos a plazo y swaps	USD	110.000
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	JPMorgan	Contratos a plazo	EUR	110.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	JPMorgan	Contratos a plazo	EUR	110.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	JPMorgan	Contratos a plazo	EUR	300.000
Threadneedle (Lux) - European Select	JPMorgan	Contratos a plazo	EUR	510.000
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	JPMorgan	Contratos a plazo	GBP	120.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Goldman Sachs	Contratos a plazo y swaps	EUR	200.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	UBS	Swaps	EUR	120.000
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	UBS	Swaps	USD	80.000
Garantía pagada por la Cartera				
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	Barclays	Contratos a plazo y swaps	USD	60.000
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	JPMorgan	Contratos a plazo y swaps	USD	20.230.000
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	NatWest Markets	Contratos a plazo	EUR	230.000
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	Lloyds	Contratos a plazo	EUR	20.000
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	JPMorgan	Contratos a plazo	EUR	240.000
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	JPMorgan	Contratos a plazo	EUR	760.000
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	Goldman Sachs	Swaps	EUR	10.000
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	NatWest Markets	Contratos a plazo	EUR	110.000
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	JPMorgan	Contratos a plazo	USD	470.000
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	JPMorgan	Contratos a plazo	USD	440.000
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	JPMorgan	Contratos a plazo	USD	1.110.000
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	JPMorgan	Contratos a plazo	USD	250.000
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	JPMorgan	Contratos a plazo	USD	210.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	NatWest Markets	Contratos a plazo	USD	120.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	JPMorgan	Contratos a plazo y swaps	USD	960.000
Threadneedle (Lux) - Global Focus	JPMorgan	Contratos a plazo	USD	3.400.000
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	JPMorgan	Contratos a plazo	EUR	200.000
Threadneedle (Lux) - American	JPMorgan	Contratos a plazo	USD	3.690.000
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	JPMorgan	Contratos a plazo	USD	1.930.000
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	JPMorgan	Contratos a plazo	USD	610.000
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	JPMorgan	Contratos a plazo	EUR	110.000
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	JPMorgan	Contratos a plazo	USD	130.000
Threadneedle (Lux) - Global Technology	JPMorgan	Contratos a plazo	USD	1.290.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Citigroup Global Markets	Swaps	EUR	70.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Lloyds	Contratos a plazo	EUR	210.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	BNP Paribas	Swaps	EUR	220.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Barclays	Contratos a plazo y swaps	EUR	300.000
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	UBS	Swaps	USD	400.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Macquarie	Swaps	USD	720.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Goldman Sachs	Swaps	USD	1.420.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	JPMorgan	Contratos a plazo y swaps	USD	2.820.000

Notas a los estados financieros

(continuación)

18 INVERSIÓN CRUZADA EN CARTERAS

A 30 de septiembre de 2023, Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return Portfolio invierte en acciones de Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities Portfolio por un valor de 850.827 USD, que representa el 0,49% del patrimonio neto de Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities Portfolio.

El impacto de las transacciones de inversión cruzada ha sido eliminado del Estado consolidado del patrimonio neto y del Estado de variaciones en el patrimonio neto.

Consulte también la nota 2 xi) sobre los reembolsos de comisiones de gestión de activos.

19 DEPÓSITOS A PLAZO

La siguiente tabla muestra los depósitos a plazo que mantiene la SICAV a 30 de septiembre de 2023:

Carteras	Contraparte	Divisa	Depósitos a plazo (en la divisa base de la Cartera)
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	Sumitomo Bank Ltd London	USD	661.451
	Mitsubishi UFJ Securities	USD	574.890
	Total	USD	1.236.341
Threadneedle (Lux) - American Select	Mitsubishi UFJ Securities	USD	4.220.003
	Total	USD	4.220.003
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	Mitsubishi UFJ Securities	USD	3.660.891
	ANZ Banking Group Ltd	USD	2.132.198
	Total	USD	5.793.089

20 OTROS ACTIVOS

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

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

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

La fórmula aplicada es la siguiente:

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

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

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

Los Índices de Gastos Totales para el periodo cerrado a 30 de septiembre de 2023 son los siguientes:

Cartera	Clase de Acciones	IGT	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	AEC	0,80%	
	AEH	0,80%	
	AKH	0,64%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ANH	0,64%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	AU	0,80%	
	AUP	0,80%	
	DEC	1,55%	
	DEH	1,55%	
	DU	1,55%	
	DUP	1,55%	
	IEC	0,50%	
	IEH	0,50%	
	IEP	0,50%	
	IGC	0,50%	
	IGH	0,50%	
	IKH	0,50%	
	INH	0,50%	
	IU	0,50%	
	IUP	0,50%	
	NEC	0,40%	
	NEH	0,40%	
	NGC	0,40%	
	NGH	0,40%	
NU	0,40%		
NUP	0,40%		
XEH	0,10%		
XFH	0,10%		
XGH	0,10%		
XU	0,10%		
XVC	0,05%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al reciente lanzamiento de la clase.	
ZEH	0,55%		
ZFH	0,50%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.	
ZGH	0,55%		
ZU	0,55%		
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	AE	0,80%	
	ANH	0,64%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IE	0,50%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	IGT	Comentarios
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond (continuación)	IEP	0,50%	
	INH	0,50%	
	NE	0,08%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al reciente lanzamiento de la clase.
	NEP	0,08%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al reciente lanzamiento de la clase.
	XE	0,10%	
	XFH	0,10%	
	XGH	0,10%	
	XUH	0,10%	
	ZE	0,55%	
	ZFH	0,55%	
	1E	1,19%	
	1G	1,19%	
	2E	0,58%	
	2G	0,51%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	3G	0,69%	
	4E	0,08%	
	4G	0,08%	
	8E	0,62%	
	8G	0,62%	
	9G	0,60%	
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	AE	1,45%	
	AKH	1,25%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ANH	1,26%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IE	0,65%	
	IEP	0,65%	
	IKH	0,60%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	INH	0,58%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	XE	0,10%	
	ZE	0,75%	
	ZEP	0,75%	
	1E	1,38%	
	1EP	1,38%	
	1G	1,38%	
	1GP	1,38%	
	1UT	1,38%	
	2E	0,82%	
	2EP	0,82%	
	2FH	0,82%	
	2G	0,82%	
	2GP	0,67%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	3E	0,77%	
	3EP	0,77%	
	3FC	0,77%	
	3FH	0,77%	
	3G	0,77%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	IGT	Comentarios
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond (continuación)	3GP	0,77%	
	4E	0,07%	
	4G	0,01%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	8E	0,86%	
	8EP	0,86%	
	8FH	0,86%	
	8G	0,86%	
	8GP	0,86%	
	9E	0,70%	
	9EP	0,70%	
	9FC	0,58%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	9FH	0,56%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	9G	0,62%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	9GP	0,63%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	AE	0,90%	
	AEP	0,90%	
	AKH	0,90%	
	ANH	0,90%	
	IE	0,50%	
	IEP	0,50%	
	IGC	0,50%	
	IGH	0,50%	
	IKH	0,50%	
	INH	0,50%	
	XE	0,10%	
	XGC	0,10%	
	XGH	0,10%	
	ZE	0,50%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	AE	0,55%	
	AEP	0,55%	
	AFH	0,55%	
	AKH	0,55%	
	ANH	0,55%	
	ASC	0,61%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ASH	0,55%	
	AUC	0,55%	
	AUH	0,55%	
	ID	0,40%	
	IE	0,40%	
	IEP	0,40%	
	IFH	0,40%	
	IGH	0,49%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IKH	0,55%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	IGT	Comentarios
Threadneedle (Lux) - European Social Bond (continuación)	INH	0,52%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ISC	0,12%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ISH	0,26%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IUC	0,40%	
	IUH	0,40%	
	LE	0,40%	
	NEP	0,40%	
	ZD	0,45%	
	ZE	0,45%	
	ZEP	0,45%	
	ZFH	0,45%	
	ZGC	0,45%	
	ZGH	0,45%	
	ZUH	0,45%	
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	AE	1,10%	
	AEP	1,10%	
	AKH	1,10%	
	ANH	1,04%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	AUH	1,10%	
	DE	1,65%	
	DEP	1,65%	
	DUH	1,44%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IE	0,50%	
	INH	0,50%	
ZE	0,55%		
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	AEC	1,55%	
	AEH	1,55%	
	AKH	1,49%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ANH	1,49%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ASH	1,55%	
	AU	1,55%	
	AUP	1,55%	
	DEC	1,65%	
	DEH	1,65%	
	DU	1,65%	
	IEC	0,75%	
	IEH	0,75%	
	IU	0,75%	
	W	1,20%	
	WEH	1,20%	
XUP	0,10%		
ZU	0,56%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.	
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	AEC	1,55%	
	AEH	1,55%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	IGT	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt (continuación)	AKH	1,34%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ANH	1,41%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ASH	1,55%	
	AU	1,55%	
	AUP	1,55%	
	DEH	1,65%	
	DU	1,65%	
	IEH	0,75%	
	IU	0,75%	
	SU	1,70%	
	SUP	1,70%	
	W	1,20%	
	XUP	0,10%	
	ZU	0,58%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	AEC	1,50%	
	AEH	1,50%	
	AKH	1,40%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ANH	1,42%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ASC	1,50%	
	ASH	1,50%	
	AU	1,50%	
	AUP	1,50%	
	DEH	1,65%	
	DU	1,65%	
	IE	0,75%	
	IEH	0,75%	
	XU	0,10%	
	XUP	0,10%	
	ZEH	0,75%	
	ZU	0,75%	
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	AEC	1,45%	
	AEH	1,45%	
	AKH	1,32%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ANH	1,39%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ASH	1,45%	
	AU	1,45%	
	AUP	1,45%	
	DEC	1,65%	
	DEH	1,65%	
	DU	1,65%	
	IEC	0,58%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IEH	0,65%	
	IKH	0,57%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	IGT	Comentarios
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond (continuación)	INH	0,58%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ISC	0,65%	
	IU	0,65%	
	TEH	0,65%	
	XUP	0,10%	
	ZFH	0,68%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZGH	0,59%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZU	0,75%	
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	AEH	1,10%	
	AKH	1,10%	
	AS	1,10%	
	ASC	1,10%	
	ASH	1,10%	
	AU	1,10%	
	AUP	1,10%	
	AVC	0,89%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	AVH	1,10%	
	DEH	1,40%	
	IEH	0,50%	
	IGH	0,50%	
	ISH	0,50%	
	IU	0,50%	
	XU	0,10%	
	ZU	0,55%	
	ZUP	0,55%	
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	AEC	1,65%	
	AEH	1,65%	
	AKH	1,79%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	AU	1,65%	
	AUP	1,65%	
	DEH	2,30%	
	DU	2,30%	
	IEH	0,95%	
	IGH	0,95%	
	IU	0,95%	
	W	1,75%	
	ZU	1,14%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	AE	1,55%	
	AEC	1,55%	
	AEH	1,55%	
	AEP	1,55%	
	AS	1,69%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ASC	1,55%	
	ASH	1,55%	
	ASP	1,55%	
	AU	1,55%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	IGT	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income (continuación)	AUM	1,55%	
	AUP	1,55%	
	DEC	2,30%	
	DEH	2,30%	
	DEP	2,30%	
	DU	2,30%	
	DUP	2,30%	
	ZE	1,12%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZEC	1,25%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZEH	1,05%	
	ZFH	1,14%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZU	1,05%	
	ZUP	1,16%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
Threadneedle (Lux) - Global Focus	AEH	1,70%	
	AEP	1,70%	
	ASH	1,70%	
	AU	1,70%	
	AUP	1,70%	
	DEH	2,45%	
	DU	2,45%	
	IE	0,85%	
	IEH	0,85%	
	IU	0,85%	
	IUP	0,85%	
	W	1,60%	
	XU	0,10%	
	ZE	0,90%	
	ZEH	0,90%	
	ZEP	0,90%	
	ZFH	0,90%	
	ZG	0,90%	
	ZU	0,90%	
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	AEH	1,70%	
	AU	1,70%	
	DEH	2,45%	
	DU	2,45%	
	IE	0,85%	
	IEH	0,85%	
	IU	0,85%	
	XU	0,10%	
	ZU	0,90%	
	1E	1,71%	
	1U	1,71%	
	2E	1,10%	
	2U	1,10%	
	8E	1,21%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	8U	1,14%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	IGT	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	AEC	1,80%	
	AUP	1,89%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	DEC	2,36%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	DUP	2,30%	
	IU	0,95%	
	TE	1,09%	
	ZU	1,05%	
	1E	1,68%	
	1EP	1,68%	
	1SC	1,68%	
	1SH	1,68%	
	1ST	1,68%	
	1U	1,68%	
	1UP	1,68%	
	1VT	1,68%	
	2E	1,07%	
	2EP	1,07%	
	2U	1,07%	
	2UP	1,07%	
	3E	0,93%	
	3EP	0,93%	
	3U	0,93%	
	3UP	0,93%	
	8E	1,11%	
	8EP	1,11%	
	8U	1,11%	
	8UP	1,11%	
	9E	0,83%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	9EP	0,84%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	9U	0,83%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	9UP	0,89%	
Threadneedle (Lux) - Global Select	IU	0,85%	
	ZU	0,90%	
	1E	1,68%	
	1U	1,68%	
	2E	1,07%	
	2U	1,07%	
	3U	0,90%	
	8E	1,11%	
	8U	1,11%	
	9U	0,85%	
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	AE	1,80%	
	AEP	1,80%	
	AK	1,80%	
	AUP	1,80%	
	DE	2,30%	
	IE	0,95%	
	IEP	0,95%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	IGT	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies (continuación)	IG	0,95%	
	NE	0,75%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la reducción de las comisiones aplicadas a esta clase de acciones el 20 de septiembre de 2023.
	XE	0,15%	
	XFH	0,15%	
	XG	0,08%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	XGH	0,08%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	XU	0,15%	
	ZE	1,05%	
	ZFH	1,05%	
	ZG	1,05%	
	ZGH	1,05%	
	ZU	1,05%	
Threadneedle (Lux) - American	AEH	1,80%	
	AU	1,80%	
	DEH	2,15%	
	DU	2,15%	
	IEH	0,90%	
	IU	0,90%	
	W	1,50%	
	ZE	1,00%	
	ZEH	1,00%	
	ZU	1,10%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	1E	1,67%	
	1EH	1,67%	
	1EP	1,67%	
	1U	1,67%	
	2E	1,06%	
	2U	1,06%	
	3EH	0,88%	
	3U	0,88%	
	8E	1,10%	
	8U	1,10%	
	9EH	0,84%	
	9U	0,84%	
Threadneedle (Lux) - American Select	AD	1,85%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	AEH	1,80%	
	AN	1,85%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	AU	1,80%	
	DEH	2,55%	
	DU	2,55%	
	ID	0,93%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IE	0,90%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la significativa variación del VL medio.
	IEH	1,00%	
	IN	0,93%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	IGT	Comentarios
Threadneedle (Lux) - American Select (continuación)	W	1,75%	
	ZEH	1,20%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZU	1,10%	
	1E	1,67%	
	1EH	1,67%	
	1EP	1,67%	
	1U	1,67%	
	2EH	1,06%	
	2U	1,06%	
	3E	0,87%	
	3U	0,87%	
	8EH	1,10%	
	8U	1,10%	
	9E	0,83%	
	9U	0,83%	
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	AE	1,63%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la significativa variación del VL medio.
	AEH	1,80%	
	ASH	1,80%	
	AU	1,80%	
	DEH	2,30%	
	DU	2,30%	
	IE	0,95%	
	IFH	0,95%	
	IU	0,95%	
	NE	0,70%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al reciente lanzamiento de la clase.
	ZE	1,05%	
	ZU	1,05%	
	1E	1,68%	
	1EP	1,68%	
	1U	1,68%	
	2U	1,07%	
	3EH	0,93%	
	3U	0,93%	
	8U	1,11%	
	9EH	0,89%	
	9U	0,89%	
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	AE	1,80%	
	AF	1,96%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	AS	1,80%	
	ASH	1,80%	
	AU	1,80%	
	DE	2,55%	
	IF	0,75%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ISH	0,75%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IU	0,95%	
	XU	0,15%	
	XUP	0,15%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	IGT	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity (continuación)	ZE	1,05%	
	ZEH	1,05%	
	ZF	1,05%	
	ZG	1,05%	
	ZU	1,05%	
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	AE	1,97%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	AEH	1,60%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	DE	2,48%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	DEH	2,12%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IE	0,95%	
	IU	0,95%	
	ZU	1,05%	
	1E	1,70%	
	1U	1,70%	
	2E	1,09%	
	2U	1,09%	
	3U	0,95%	
	8E	1,13%	
	8U	1,13%	
	9U	0,91%	
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	AEC	1,85%	
	AEH	1,85%	
	AU	1,85%	
	AUP	1,85%	
	DU	2,35%	
	IU	1,05%	
	XS	0,07%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	XSH	0,15%	
	ZEH	1,10%	
	ZFH	1,10%	
	ZGH	1,19%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZU	1,10%	
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	AE	0,70%	
	AEH	0,56%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	AU	0,61%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	AUP	0,59%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	DE	0,90%	
	DEH	0,95%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la significativa variación del VL medio.
	DU	0,90%	
	IE	0,35%	
	IEC	0,35%	
	IEH	0,35%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	IGT	Comentarios
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities (continuación)	IFH	0,35%	
	IG	0,35%	
	IU	0,35%	
	NE	0,20%	
	NG	0,20%	
	NU	0,20%	
	XG	0,10%	
	ZEH	0,45%	
	ZFH	0,45%	
	ZU	0,45%	
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	AE	1,50%	
	ASH	1,50%	
	AUH	1,50%	
	DE	1,70%	
	IE	0,75%	
	W	1,60%	
	XE	0,10%	
	ZE	0,90%	
	ZUH	0,90%	
	1E	1,53%	
	1EP	1,62%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	1G	1,53%	
	1GP	1,62%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	2E	1,08%	
	2G	1,08%	
	2U	0,98%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	3E	0,94%	
	3G	0,94%	
	3GP	0,94%	
	4E	0,08%	
	4G	0,08%	
	8E	1,12%	
	8G	1,12%	
	8U	1,00%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	9E	0,85%	
	9G	0,85%	
	9GP	0,85%	
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	AE	1,80%	
	AEP	1,80%	
	AUP	1,89%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	DE	2,15%	
	DEP	2,15%	
	IE	0,65%	
	IEP	0,65%	
	ZE	1,17%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZEP	1,05%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	IGT	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend (continuación)	1E	1,70%	
	1EP	1,70%	
	1G	1,70%	
	1GP	1,70%	
	2E	1,09%	
	2EP	1,03%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	2G	0,99%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	2GP	1,03%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	3EP	0,95%	
	3G	0,95%	
	3GP	0,95%	
	4GP	0,09%	
	8E	1,13%	
	8EP	1,13%	
	8G	1,13%	
	8GP	1,13%	
	9EP	0,91%	
	9G	0,86%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	9GP	0,91%	
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	AE	1,85%	
	ASH	1,85%	
	AUH	1,85%	
	DE	2,75%	
	DUH	2,75%	
	IE	1,10%	
	W	1,90%	
	XE	0,07%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZE	1,10%	
	ZFH	1,10%	
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	IE	0,95%	
	ZE	1,10%	
	1E	1,72%	
	1EP	1,72%	
	1FH	1,72%	
	1G	1,72%	
	1UH	1,72%	
	2E	1,07%	
	2G	1,07%	
	3E	0,91%	
	3EP	0,91%	
	3FH	0,91%	
	3G	0,91%	
	3GP	0,91%	
	3UH	0,91%	
	4E	0,07%	
	4G	0,07%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	IGT	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies (continuación)	8E	1,11%	
	8G	1,11%	
	9E	0,87%	
	9EP	0,79%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	9FH	0,87%	
	9G	0,87%	
	9GP	0,75%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	9UH	0,87%	
Threadneedle (Lux) - European Select	AE	1,80%	
	AGH	1,80%	
	AUH	1,80%	
	DUH	2,40%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IE	0,95%	
	ZE	1,21%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZG	1,05%	
	ZGH	1,05%	
	1E	1,65%	
	1EP	1,65%	
	1SH	1,65%	
	1U	1,65%	
	1UH	1,65%	
	2E	1,06%	
	2EP	0,97%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	3E	0,88%	
	3U	0,88%	
	8E	1,10%	
	8EP	1,10%	
	9E	0,84%	
	9U	0,84%	
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	IE	0,95%	
	ZE	1,10%	
	1E	1,72%	
	1EP	1,72%	
	1FH	1,55%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	2E	1,07%	
	3E	0,93%	
	3EP	0,93%	
	3FH	0,93%	
	8E	1,11%	
	9E	0,89%	
	9EP	0,89%	
	9FH	0,89%	
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	AEH	1,80%	
	ASC	1,80%	
	AU	1,80%	
	AUP	1,80%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	IGT	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income (continuación)	DEH	2,55%	
	DU	2,55%	
	DUP	2,55%	
	IEP	0,95%	
	IU	0,95%	
	W	2,00%	
	XU	0,15%	
	XUP	0,15%	
	ZG	1,18%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZGH	1,05%	
	ZGP	1,23%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZU	1,16%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZUP	1,05%	
Threadneedle (Lux) - Global Technology	AEH	1,95%	
	AS	1,95%	
	AU	1,95%	
	AUP	1,95%	
	BU	2,35%	
	DEH	2,30%	
	DU	2,30%	
	IE	1,05%	
	IEH	1,05%	
	IG	1,05%	
	IU	1,05%	
	ZEH	1,15%	
	ZFH	1,15%	
	ZG	1,15%	
	ZU	1,15%	
Threadneedle (Lux) - UK Equities	AE	1,80%	
	AEH	1,80%	
	AFH	1,80%	
	AG	1,80%	
	AGP	1,80%	
	DEH	2,60%	
	DG	2,77%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la significativa variación del VL medio.
	IE	0,85%	
	IEH	0,85%	
	IG	0,85%	
	IGP	0,85%	
	NEH	0,57%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	NFH	0,58%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	NG	0,68%	
	NGP	0,57%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	NUH	0,57%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	IGT	Comentarios
Threadneedle (Lux) - UK Equities (continuación)	TEH	0,62%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	TFH	0,59%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	TG	0,62%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	TGP	0,63%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	TUH	0,58%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZE	1,05%	
	ZEH	1,05%	
	ZFH	1,05%	
	ZG	1,05%	
	ZGP	1,05%	
	ZUH	1,05%	
	3EH	0,87%	
	3FH	0,87%	
	3UH	0,87%	
	9EH	0,83%	
	9EP	0,83%	
	9FH	0,83%	
	9G	0,83%	
	9UH	0,83%	
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	AE	1,80%	
	AEC	1,80%	
	AEH	1,80%	
	AG	1,80%	
	ASC	1,80%	
	AUC	1,80%	
	DE	2,55%	
	DEC	2,55%	
	DEH	2,55%	
	DG	2,55%	
	DGP	2,47%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la significativa variación del VL medio.
	IE	0,85%	
	IEH	0,85%	
	IG	0,85%	
	IGP	0,85%	
	IU	0,85%	
	IUH	0,85%	
	LG	0,70%	
	LGP	0,70%	
	ZE	1,05%	
	ZEH	1,05%	
	ZFH	1,05%	
	ZG	1,05%	
	ZGP	1,05%	
	ZUH	1,05%	
	1EH	1,64%	
	1FH	1,64%	
1UH	1,64%		

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	IGT	Comentarios
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income (continuación)	3EH	0,88%	
	3FH	0,88%	
	3UH	0,88%	
	9EH	0,84%	
	9FH	0,84%	
	9G	0,84%	
	9UH	0,84%	
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	AE	1,20%	
	IE	0,51%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZE	0,70%	
	1E	1,17%	
	1EP	1,17%	
	1GH	1,17%	
	1UH	1,17%	
	2E	0,56%	
	2EP	0,56%	
	2GC	0,48%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	2GH	0,56%	
	4GH	0,06%	
	8E	0,60%	
	8EP	0,60%	
	8GC	0,60%	
	8GH	0,60%	
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	AE	1,10%	
	AFH	0,94%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	AKH	1,04%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ANH	1,04%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	AUH	1,10%	
	DE	1,65%	
	IE	0,45%	
	IEP	0,45%	
	IGH	0,45%	
	INH	0,45%	
	IU	0,45%	
	IUH	0,45%	
	JE	0,44%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	JGH	0,43%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	JUH	0,35%	
	LE	0,30%	
	LEP	0,16%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	LGH	0,14%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	XE	0,10%	
	XGH	0,10%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	IGT	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities (continuación)	XUH	0,10%	
	YE	0,50%	
	YGH	0,50%	
	YUH	0,50%	
	ZE	0,53%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZFH	0,49%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZGH	0,53%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZUH	0,48%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	AE	1,85%	
	AEP	1,85%	
	AUH	1,90%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	DE	2,35%	
	IE	0,95%	
	IGH	0,95%	
	LE	0,58%	
	XGH	0,15%	
	ZE	1,05%	
	ZF	1,16%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZFH	1,12%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZGH	1,15%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	AEH	1,80%	
	AU	1,80%	
	DEH	2,30%	
	DU	2,30%	
	IU	0,90%	
	ZU	1,15%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	1E	1,69%	
	1EH	1,69%	
	1U	1,69%	
	2E	0,83%	
	2U	0,83%	
	3U	0,94%	
	8E	0,87%	
	8U	0,87%	
	9U	0,90%	
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	AEH	1,80%	
	AU	1,80%	
	DEH	2,30%	
	DU	2,30%	
	IU	0,90%	
	ZU	1,17%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	1E	1,69%	
	1U	1,69%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	IGT	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha (continuación)	2E	0,83%	
	2U	0,83%	
	8E	0,87%	
	8U	0,87%	
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	AEH	1,20%	
	AFH	1,20%	
	AGH	1,20%	
	ASH	1,20%	
	AU	1,20%	
	DEH	1,45%	
	DU	1,45%	
	IEH	0,90%	
	IG	0,90%	
	IGH	0,90%	
	IU	0,90%	
	NG	0,55%	
	XU	0,10%	
	ZEH	0,90%	
	ZFH	0,76%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZGH	0,90%	
	ZU	0,90%	

22 EVENTOS SUBSECUENTES

Con efecto a partir del 11 de octubre de 2023, Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity Portfolio se puso en liquidación.

Está previsto que CT (Lux) Global Social Bond Portfolio se lance el 5 de diciembre de 2023.

Está previsto que CT (Lux) Japan Equities Portfolio se lance el 14 de diciembre de 2023.

Con efecto a partir del 18 de octubre de 2023, las comisiones de gestión de activos y las comisiones de gastos operativos se reducirán en algunas Clases de acciones de varias Carteras como se indica a continuación:

Cartera	Clase de Acciones	Hasta el 17 de octubre de 2023			A partir del 18 de octubre de 2023		
		Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	IGT esperado	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	IGT esperado
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	Acciones I	0,55%	0,10%	0,65%	0,45%	0,10%*	0,55%
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	Acciones T	0,55%	0,10%	0,65%	0,45%	0,10%*	0,55%
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	Acciones Z	0,60%	0,15%	0,75%	0,45%	0,15%*	0,60%
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	Acciones I	0,75%	0,20%	0,95%	0,75%*	0,10%	0,85%
Threadneedle (Lux) - American Select	Acciones I	0,80%	0,20%	1,00%	0,80%*	0,10%	0,90%
Threadneedle (Lux) - American Select	Acciones Z	0,75%	0,35%	1,10%	0,75%*	0,15%	0,90%
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	Acciones Z	0,75%	0,35%	1,10%	0,75%*	0,15%	0,90%
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	Acciones I	0,75%	0,20%	0,95%	0,75%*	0,10%	0,85%
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	Acciones X	n/d	0,15%	0,15%	n/d	0,10%	0,10%

Notas a los estados financieros

(continuación)

22 EVENTOS SUBSECUENTES

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Hasta el 17 de octubre de 2023			A partir del 18 de octubre de 2023		
		Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	IGT esperado	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	IGT esperado
Threadneedle (Lux) - Global Technology	Acciones I	0,85%	0,20%	1,05%	0,85%*	0,10%	0,95%
Threadneedle (Lux) - Global Technology	Acciones Z	0,85%	0,30%	1,15%	0,85%*	0,15%	1,00%

* Sin cambios.

Con efecto a partir del 20 de noviembre de 2023, Threadneedle (Lux) pasó a denominarse Columbia Threadneedle (Lux) I y las Carteras pasaron a denominarse como se indica a continuación:

Nombre actual de la Cartera	Nuevo nombre de la Cartera
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	CT (Lux) Global Corporate Bond
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	CT (Lux) European Corporate Bond
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	CT (Lux) European High Yield Bond
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	CT (Lux) European Short-Term High Yield Bond
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	CT (Lux) European Social Bond
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	CT (Lux) European Strategic Bond
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	CT (Lux) Emerging Market Corporate Bonds
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	CT (Lux) Emerging Market Debt
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	CT (Lux) Global Emerging Market Short-Term Bonds
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	CT (Lux) US High Yield Bond
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	CT (Lux) Flexible Asian Bond
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	CT (Lux) Global Dynamic Real Return
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	CT (Lux) Global Multi Asset Income
Threadneedle (Lux) - Global Focus	CT (Lux) Global Focus
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	CT (Lux) Global Emerging Market Equities
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	CT (Lux) Global Equity Income
Threadneedle (Lux) - Global Select	CT (Lux) Global Select
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	CT (Lux) Global Smaller Companies
Threadneedle (Lux) - American	CT (Lux) American
Threadneedle (Lux) - American Select	CT (Lux) American Select
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	CT (Lux) American Smaller Companies
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	CT (Lux) Asia Equities
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	CT (Lux) US Contrarian Core Equities
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	CT (Lux) US Disciplined Core Equities
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	CT (Lux) Pan European ESG Equities
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	CT (Lux) Pan European Equity Dividend
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	CT (Lux) Pan European Small Cap Opportunities
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	CT (Lux) Pan European Smaller Companies
Threadneedle (Lux) - European Select	CT (Lux) European Select
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	CT (Lux) European Smaller Companies
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	CT (Lux) Asian Equity Income
Threadneedle (Lux) - Global Technology	CT (Lux) Global Technology
Threadneedle (Lux) - UK Equities	CT (Lux) UK Equities
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	CT (Lux) UK Equity Income
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	CT (Lux) Credit Opportunities
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	CT (Lux) Global Investment Grade Credit Opportunities
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	CT (Lux) Pan European Absolute Alpha
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	CT (Lux) American Extended Alpha
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	CT (Lux) Global Extended Alpha
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	CT (Lux) Enhanced Commodities

Notas a los estados financieros

(continuación)

23 INFORMACIÓN ADICIONAL

La invasión a gran escala de Ucrania por parte de Rusia en febrero de 2022 ha dado lugar a sanciones y perturbaciones en el mercado, entre las que se incluyen la volatilidad de los mercados bursátiles y de materias primas regionales y mundiales, e importantes devaluaciones de la divisa rusa. El alcance y la duración de la acción militar son imposibles de predecir, pero podrían ser considerables. La perturbación del mercado causada por la acción militar rusa y cualquier contramedida o respuesta a ella (incluidas las sanciones internacionales, una rebaja de la calificación crediticia de un país, restricciones de compra y financiación, boicots, aranceles, cambios en las preferencias de los consumidores o compradores, ciberataques y espionaje) podrían tener impactos adversos graves en los mercados regionales y/o mundiales de valores y materias primas, incluidos los mercados de petróleo y gas natural. Estos y otros acontecimientos relacionados podrían tener un impacto negativo en el rendimiento de las Carteras y en el valor de las inversiones en las Carteras.

Información para los accionistas

La SICAV es una sociedad de inversión organizada como una «*Société d'Investissement à Capital Variable*» en el Gran Ducado de Luxemburgo en virtud de la Ley del 10 de agosto de 1915, en su versión modificada, y califica como un Organismo de inversión colectiva en valores mobiliarios («OICVM») en virtud de la Parte I de la Ley del 17 de diciembre de 2010, en su versión modificada.

La SICAV se constituyó el 10 de febrero de 1995 por un periodo ilimitado. Los estatutos de la SICAV se publicaron por primera vez en el *Recueil des Sociétés et Associations* (registro mercantil) del Gran Ducado de Luxemburgo el 31 de marzo de 1995 y se modificaron por última vez a partir del 14 de septiembre de 2018. El 27 de septiembre de 2023, se celebró una junta general extraordinaria en la se acordó la modificación del nombre de la SICAV y de sus Carteras, así como otros cambios relativos a los estatutos, con efecto a partir del 20 de noviembre de 2023.

La SICAV está registrada en el Registro Mercantil de Luxemburgo con el número B-50216.

La junta general anual de Accionistas de la SICAV se celebrará en Luxemburgo, según se especifique en la convocatoria, dentro de los seis meses siguientes al cierre del ejercicio contable. La junta general anual podrá celebrarse en el extranjero si, a juicio absoluto y definitivo del Consejo, las circunstancias excepcionales así lo requieren. Las demás juntas de Accionistas podrán celebrarse en el lugar y plazo de la convocatoria que se especifique en las respectivas convocatorias. Las convocatorias de las juntas generales se realizan de acuerdo con la legislación luxemburguesa y de acuerdo con las normas aplicables en los países pertinentes en los que las Acciones se ofrecen públicamente a la venta. En las convocatorias se especificarán el lugar y la hora de la junta, las condiciones de admisión, el orden del día, el quórum y los requisitos de votación.

El ejercicio contable de la SICAV finaliza el 31 de marzo de cada año.

El informe anual y los estados financieros auditados y el informe semestral no auditado están disponibles en el domicilio social de la SICAV y en la oficina principal de cada agente de pagos y distribuidor. Las cuentas combinadas de la SICAV se expresan en dólares estadounidenses.

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

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

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

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

El KIID/KID es un documento precontractual y los inversores deberán confirmar que han leído el último KIID/KID antes de hacer una suscripción. La Sociedad Gestora tiene el derecho de rechazar una suscripción si el inversor no confirma que ha leído el último KIID/KID en el momento de la solicitud.

El último KIID/KID se podrá obtener en www.columbiathreadneedle.com.

Información para inversores en Suiza

El informe anual y los estados financieros auditados, el informe semestral no auditado, el informe sobre los cambios en las participaciones de la Cartera correspondiente al periodo, los estatutos, el Folleto (versión suiza) y el KIID podrán obtenerse previa solicitud y sin coste alguno en las oficinas del Representante y agente de pagos suizo de la SICAV, Caceis Investor Services Bank S.A., Esch-sur-Alzette, Sucursal de Zürich, Bleicherweg 7, 8027 Zürich, Suiza, o en el domicilio social de la SICAV.

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

Reglamento de operaciones de financiación de valores

El Reglamento (UE) 2015/2365 del Parlamento Europeo y del Consejo sobre transparencia de las operaciones de financiación de valores y de reutilización («SFTR», por sus siglas en inglés) presenta los requisitos de información de operaciones de financiación de valores («SFT», por sus siglas en inglés) y de swaps de rentabilidad total. Una SFT viene definida en el artículo 3(11) del SFTR como:

- un acuerdo de recompra/recompra inversa;
- préstamos de valores o materias primas y empréstitos de valores o materias primas;
- una operación de compra con pacto de reventa o una operación de venta con pacto de recompra; o
- una operación de préstamo de márgenes.

A 30 de septiembre de 2023, la SICAV realizó swaps de rentabilidad total («SRT») como tipo de instrumentos en el alcance del SFTR.

Datos globales

Nombre de la Cartera	Tipo de activo	Ganancias y pérdidas no realizadas en la divisa base de la Cartera y en valor absoluto	% del patrimonio neto
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	SRT	79.351	0,17
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	SRT	42.384	0,08
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	SRT	806.190	0,99
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	SRT	4.997.914	2,87

Datos sobre la reutilización de garantías

No hubo reutilización de garantías durante el periodo cerrado a 30 de septiembre de 2023.

Datos de concentración

Todas las garantías recibidas con respecto a SRT a 30 de septiembre de 2023 son garantías en efectivo. Por consiguiente, no se aplica la disposición sobre los diez mayores emisores.

La siguiente tabla proporciona detalles de las diez principales contrapartes (en función del volumen bruto de transacciones pendientes) con respecto a SRT mantenidas por cada Cartera a 30 de septiembre de 2023:

Nombre de la Cartera	Tipo de activo	Contraparte	Ganancias y pérdidas no realizadas en la divisa base de la Cartera y en valor absoluto
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	SRT	UBS	69.717
		Goldman Sachs	9.634
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	SRT	Bank of America Merrill Lynch	41.209
		UBS	1.175
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	SRT	UBS	806.190
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	SRT	Goldman Sachs	2.192.932
		JPMorgan	1.701.275
		Macquarie	1.103.707

Custodia de las garantías recibidas

La garantía en efectivo se recibe en la cuenta de efectivo de cada Cartera en Citibank Europe plc, Sucursal de Luxemburgo.

Reglamento de operaciones de financiación de valores

(continuación)

La siguiente tabla muestra los depósitos a plazo que mantiene la SICAV a 30 de septiembre de 2023:

Nombre de la Cartera	Tipo de garantía	Contraparte	Divisa de garantía	Importe de garantía
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	Efectivo	UBS	EUR	120.000
		Total	EUR	120.000
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Efectivo	UBS	USD	80.000
		Total	USD	80.000

Datos generales de operaciones

Nombre de la Cartera	Tipo de garantía	Plazo de vencimiento (garantía)	Divisa de garantía	Plazo de vencimiento (SFT/SRT)	País de establecimiento (contraparte)	Liquidación y compensación	Calidad de la garantía
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	Efectivo	Vencimiento abierto	EUR	De 3 meses a 1 año / Más de 1 año	Reino Unido	Bilateral	N/D – Efectivo
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Efectivo	Vencimiento abierto	USD	más de 1 año	Reino Unido	Bilateral	N/D – Efectivo
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	Efectivo	Vencimiento abierto	USD	De 3 meses a 1 año / Más de 1 año	Reino Unido	Bilateral	N/D – Efectivo
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Efectivo	Vencimiento abierto	USD	de 1 día a 1 mes	Reino Unido	Bilateral	N/D – Efectivo

Custodia de las garantías otorgadas

Las garantías en efectivo y en valores pagadas a las contrapartes se ingresan en cuentas separadas de la contraparte.

El importe de la garantía concedido para SRT a 30 de septiembre de 2023 es el siguiente:

Nombre de la Cartera	Tipo de garantía	Contraparte	Divisa de garantía	Importe de garantía	% de garantía mantenida al cierre del periodo por categoría
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	Efectivo	UBS	USD	400.000	0,49
		Total	USD	400.000	0,49
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Efectivo	JPMorgan	USD	2.820.000*	1,62
		Goldman Sachs	USD	1.420.000	0,81
		Macquarie	USD	720.000	0,41
		Total	USD	4.960.000	2,84

Rendimiento/Costes

El rendimiento y los costes operativos de SRT a 30 de septiembre de 2023 se muestran en el Estado de operaciones y variaciones en el patrimonio neto de la Cartera correspondiente bajo los títulos «Gastos por intereses en swaps», «Ganancia/(Pérdida) neta realizada en swaps» y «Cambio en la ganancia/(pérdida) neta no realizada en swaps».

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

Directorio

Domicilio social

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

Asesor de inversiones

Threadneedle Management Luxembourg S.A.

Delegado a¹:

Columbia Management
Investment Advisers, LLC
290 Congress Street
Boston MA 02210
Estados Unidos de América

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

Sociedad Gestora

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

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities^{2,3}
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities³
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities
Threadneedle (Lux) - Global Technology

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond⁴
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond
Threadneedle (Lux) - European Social Bond
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds⁴
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt⁴
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds⁴
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond⁵
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return²
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income⁶
Threadneedle (Lux) - Global Focus
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income
Threadneedle (Lux) - Global Select
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies
Threadneedle (Lux) - American⁶
Threadneedle (Lux) - American Select⁶
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies⁶
Threadneedle (Lux) - Asia Equities⁵
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities⁵
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies
Threadneedle (Lux) - European Select
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income⁵
Threadneedle (Lux) - UK Equities
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha^{2,6}
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities⁴

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

Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity⁷

¹ Sujeto a la responsabilidad y supervisión de Threadneedle Management Luxembourg S.A.

² Consulte la nota 1.

³ Threadneedle Asset Management Limited ofrece recomendaciones de inversión a Columbia Management Investment Advisers, LLC y, por lo tanto, proporciona asesoramiento de inversión respaldado por investigación a Columbia Management Investment Advisers, LLC.

⁴ Threadneedle Asset Management Limited podrá, sujeto a su propia responsabilidad, delegar la gestión de inversiones discrecionales de parte de los activos de la Cartera a Columbia Management Investment Advisers, LLC.

⁵ Threadneedle Asset Management Limited podrá, sujeto a su propia responsabilidad, delegar la gestión de inversiones discrecionales de parte de los activos de la Cartera a Threadneedle Investments Singapore (Pte.) Limited.

⁶ Columbia Management Investment Advisers, LLC hace recomendaciones de inversión a Threadneedle Asset Management Limited y, por lo tanto, proporciona asesoramiento de inversión respaldado por investigación a Threadneedle Asset Management Limited.

⁷ Columbia Management Investment Advisers, LLC hace recomendaciones de inversión a Threadneedle Investments Singapore (Pte.) Limited y, por lo tanto, proporciona asesoramiento de inversión respaldado por investigación a Threadneedle Investments Singapore (Pte.) Limited.

Directorio

(continuación)

Depositario, Agente domiciliario, administrativo y de pagos

Citibank Europe plc, Sucursal de Luxemburgo
31, Z.A. Bourmicht
L-8070 Bertrange
Gran Ducado de Luxemburgo

Secretario y Agente de transferencia

International Financial Data Services (Luxembourg) S.A.
49, Avenue John F. Kennedy
L-1855 Luxemburgo
Gran Ducado de Luxemburgo

Distribuidor (delegado a una variedad de distribuidores)

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

Representantes y agentes de pago

En Austria

Erste Bank
Am Belvedere 1
1100 Viena
Austria

En Bélgica

CACEIS Belgium S.A.
Avenue du Port 86 C b 320
B-1000 Bruselas
Bélgica

En Francia

CACEIS Bank
1/3 Place Valhubert
F-75013 París
Francia

En Alemania

J.P. Morgan AG
Junghofstrasse 14
D-60311 Fráncfort del Meno
Alemania

En Hong Kong

HSBC Institutional Trust Services (Asia) Limited
17/F Tower 2 & 3 HSBC Centre
1 Sham Mong Road
Kowloon
Hong Kong

En Suiza

Caceis Investor Services Bank S.A., Esch-sur-Alzette
Sucursal de Zúrich
Bleicherweg 7
CH-8027 Zúrich
Suiza

Auditor

PricewaterhouseCoopers, *Société coopérative*
2, rue Gerhard Mercator, B.P. 1443
L-1014 Luxemburgo
Gran Ducado de Luxemburgo

Asesores legales en Luxemburgo

Linklaters LLP
35, Avenue John F. Kennedy, B.P. 1107
L-1011 Luxemburgo
Gran Ducado de Luxemburgo

Para obtener más información, visite columbiathreadneedle.com



Publicado por Threadneedle Management Luxembourg S.A. Registrado en el Registro Mercantil (Luxemburgo), con el número B 110242, 44, rue de la Vallée, L-2661 Luxemburgo, Gran Ducado de Luxemburgo. En Reino Unido, publicado por Threadneedle Asset Management Limited (TAML). Registrado en Inglaterra y Gales, con el número de registro 573204, Cannon Place, 78 Cannon Street, Londres EC4N 6AG, Reino Unido. Autorizado y regulado en Reino Unido por la Autoridad de Conducta Financiera. Columbia Threadneedle Investments es el nombre comercial global del grupo de sociedades Columbia y Threadneedle. columbiathreadneedle.com 477443