

INFORME PROVISIONAL Y ESTADOS FINANCIEROS NO AUDITADOS  
SOCIÉTÉ D'INVESTISSEMENT À CAPITAL VARIABLE  
30 DE SEPTIEMBRE DE 2021

## THREADNEEDLE (LUX)

## Contenidos

<b>Información sobre la Sociedad</b>	<b>4</b>	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	<b>47</b>
<b>Estados financieros:</b>		Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	<b>49</b>
Estados financieros agregados de Threadneedle (Lux)	<b>5</b>	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	<b>50</b>
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	<b>6</b>	Threadneedle (Lux) - European Select	<b>52</b>
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	<b>8</b>	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	<b>54</b>
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	<b>10</b>	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	<b>55</b>
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	<b>12</b>	Threadneedle (Lux) - Global Technology	<b>56</b>
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	<b>13</b>	Threadneedle (Lux) - UK Equities	<b>57</b>
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	<b>15</b>	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	<b>59</b>
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	<b>16</b>	Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity*	<b>61</b>
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	<b>17</b>	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	<b>62</b>
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	<b>18</b>	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	<b>63</b>
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	<b>19</b>	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	<b>65</b>
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	<b>21</b>	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	<b>67</b>
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	<b>22</b>	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	<b>68</b>
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	<b>23</b>	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	<b>69</b>
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	<b>24</b>	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	<b>70</b>
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	<b>26</b>	<b>Estados de la Cartera</b>	
Threadneedle (Lux) - Global Focus	<b>27</b>	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	<b>72</b>
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	<b>29</b>	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	<b>80</b>
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	<b>30</b>	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	<b>85</b>
Threadneedle (Lux) - Global Select	<b>32</b>	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	<b>94</b>
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	<b>33</b>	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	<b>99</b>
Threadneedle (Lux) - American	<b>35</b>	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	<b>108</b>
Threadneedle (Lux) - American Select	<b>37</b>	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	<b>116</b>
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	<b>39</b>	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	<b>121</b>
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	<b>40</b>	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	<b>127</b>
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	<b>41</b>	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	<b>132</b>
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	<b>42</b>	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	<b>143</b>
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	<b>43</b>	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	<b>147</b>
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	<b>45</b>		

## Contenidos

(continuación)

Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	148	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	226
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	151	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	227
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	167	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	229
Threadneedle (Lux) - Global Focus	169	<b>Notas a los estados financieros</b>	<b>230</b>
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	171	<b>Información para los accionistas</b>	<b>333</b>
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	174	<b>Información para inversores en Suiza</b>	<b>334</b>
Threadneedle (Lux) - Global Select	176	<b>Reglamento de operaciones de financiación de valores</b>	<b>335</b>
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	178	<b>Directorio</b>	<b>337</b>
Threadneedle (Lux) - American	180		
Threadneedle (Lux) - American Select	181		
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	182		
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	184		
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	186		
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	188		
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	190		
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	192		
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	194		
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	196		
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	198		
Threadneedle (Lux) - European Select	200		
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	202		
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	204		
Threadneedle (Lux) - Global Technology	206		
Threadneedle (Lux) - UK Equities	208		
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	209		
Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity*	210		
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	211		
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	212		
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	219		
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	224		

\* 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)  
Registro Mercantil de Luxemburgo n.º B-50.216

### Domicilio social

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

### Sociedad Gestora

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

### Consejo de Administración

Jonathan Allen (renunció al Consejo de Administración el 7 de mayo de 2021)

Director de Ventas Institucionales y Desarrollo de Productos de Asia y el Pacífico  
Columbia Threadneedle Investments  
Singapur

Marie-Jeanne Chèvremont-Lorenzini (renunció al Consejo de Administración el 7 de mayo de 2021)

Consejera independiente no ejecutiva  
Luxemburgo

Claude Kremer  
Consejero independiente no ejecutivo  
Luxemburgo  
Gran Ducado de Luxemburgo

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

Annemarie Nicole Arens (nombrada por el Consejo de Administración el 7 de mayo de 2021)

Consejera independiente no ejecutiva  
Luxemburgo  
Gran Ducado de Luxemburgo

Joseph Patrick LaRocque (nombrado por el Consejo de Administración el 7 de mayo de 2021)

Consejero independiente no ejecutivo  
Maryland  
Estados Unidos de América

Thomas Seale (nombrado por el Consejo de Administración el 7 de mayo de 2021)

Consejero independiente no ejecutivo  
Luxemburgo  
Gran Ducado de Luxemburgo

## Estados financieros agregados de Threadneedle (Lux)

## ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 USD
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2, 18	23.685.663.459
Efectivo en el banco	2	239.436.665
Depósitos a plazo	2, 19	85.307.513
Por cobrar para la venta de inversiones		133.874.050
Suscripciones por cobrar		49.066.776
Interés por cobrar en swaps	2	7.938.989
Interés y dividendos por cobrar, neto		46.390.784
Pago por adelantado abonado en swaps	2	1.173.747
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	3.581.814
Ganancia neta no realizada en swaps	2, 10	4.021.239
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	17.553.927
Otros activos	20	12.413.811
<b>Total de activos</b>		<b>24.286.422.774</b>
<b>Pasivos</b>		
Descubiertos bancarios		(1.178.094)
Opciones vendidas al valor de mercado	2, 12	(61.362)
Pagadero por inversiones adquiridas		(124.794.810)
Reembolsos pagaderos		(63.259.166)
Interés pagadero en swaps	2	(5.910.755)
Dividendo pagadero en swaps	2	(386.104)
Pago por adelantado cobrado en swaps	2	(1.392.329)
Interés bancario pagadero		(6.866)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(32.815.948)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(63.006.312)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	(104.672)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(20.429.139)
Comisiones de rendimiento pagaderas	8	(897.659)
Impuestos a pagar	3	(2.693.278)
Otros pasivos	20	(13.604.343)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(330.540.837)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>23.955.881.937</b>

## ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 USD
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>23.052.196.950</b>
<b>Ingresos</b>		
Dividendos, neto	2	128.365.771
Interés sobre bonos, neto	2	61.374.244
Interés bancario	2	20.553
Ingresos por intereses en swaps		929.173
Ingresos por intereses en contratos de futuros		1.848
Otros ingresos		756.251
<b>Total de ingresos</b>		<b>191.447.840</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(118.773.407)
Comisiones de rendimiento	8	(785.429)
Interés bancario	2	(562.403)
Impuestos extranjeros	3	(1.336.935)
Dividendos pagados en swaps		(2.001.953)
Gastos por intereses en swaps		(15.896.293)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(559.181)
Gastos operativos	5	(22.922.011)
<b>Total de gastos</b>		<b>(162.837.612)</b>
<b>Ingresos netos de inversiones</b>		<b>28.610.228</b>
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		1.151.832.003
Ganancia neta realizada en swaps		78.244.008
(Pérdida) neta realizada en opciones		(870.068)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(4.347.810)
(Pérdida) neta realizada en contratos de futuros		(18.322.670)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(768.179)
Ganancia neta realizada en reembolso de impuestos		20
<b>Ganancia neta realizada</b>		<b>1.205.767.304</b>
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		471.872.253
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		12.467.478
Cambio en la ganancia neta no realizada en opciones		335.991
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(14.939.319)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		12.049.482
<b>Cambio neto en ganancia no realizada</b>		<b>481.785.885</b>
<b>Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>1.716.163.417</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		3.418.994.081
Reembolsos de acciones		(4.004.703.933)
Dividendos	7	(21.367.552)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>(607.077.404)</b>
Diferencias de cambio	2	(210.083.880)
Cambio en las inversiones cruzadas en las Carteras	18	4.682.854
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>23.955.881.937</b>

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

### ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 USD
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	542.513.205
Efectivo en el banco	2	19.398.100
Suscripciones por cobrar		509.132
Interés por cobrar en swaps	2	45.921
Interés y dividendos por cobrar, neto		3.744.807
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	1.354.296
Otros activos	20	2.441
<b>Total de activos</b>		<b>567.567.902</b>
<b>Pasivos</b>		
Pagadero por inversiones adquiridas		(4.094.962)
Reembolsos pagaderos		(571.309)
Interés pagadero en swaps	2	(91.636)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(10.134.058)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(3.384.996)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(140.801)
Otros pasivos	20	(75.868)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(18.493.630)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>549.074.272</b>

### NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	1.543.297,283
Clase AEH	1.078.469,029
Clase AKH	70,000
Clase ANH	788,000
Clase AU	1.131.361,552
Clase AUP	113.696,626
Clase DEC	101.032,964
Clase DEH	214.908,693
Clase DU	202.571,000
Clase DUP	54.624,576
Clase IEC	2.156.558,859
Clase IEH	1.393.943,660
Clase IEP	74,000
Clase IGC	6.083,369
Clase IGH	1.615.666,408
Clase IKH	80.378,000
Clase INH	785,000
Clase IU	734.324,994
Clase IUP	543.091,692
Clase NEC	188.763,583
Clase NEH	103.940,495
Clase NGC	11.038.805,442
Clase NGH	1.034.000,279
Clase NU	1.524.458,902
Clase NUP	85.340,000
Clase XEH	84,000
Clase XFH	92,000
Clase XGH	9.220.264,954
Clase XU	100,000
Clase ZEH	2.139.997,958
Clase ZFH	93,000
Clase ZGH	29.365,171
Clase ZU	1.663.144,528

### ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 USD
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>505.611.566</b>
<b>Ingresos</b>		
Dividendos, neto	2	3.719
Interés sobre bonos, neto	2	6.157.437
Interés bancario	2	1.849
Ingresos por intereses en swaps		108.565
Ingresos por intereses en contratos de futuros		298
<b>Total de ingresos</b>		<b>6.271.868</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(825.328)
Interés bancario	2	(18.424)
Gastos por intereses en swaps		(935.287)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(7.329)
Gastos operativos	3, 5	(447.097)
<b>Total de gastos</b>		<b>(2.233.465)</b>
<b>Ingresos netos de inversiones</b>		<b>4.038.403</b>
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		5.098.519
(Pérdida) neta realizada en swaps		(544.414)
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		3.461.649
(Pérdida) neta realizada en contratos de futuros		(1.274.526)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		392.205
<b>Ganancia neta realizada</b>		<b>7.133.433</b>
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(2.904.806)
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		615.719
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(9.056.502)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		1.699.359
<b>Cambio neto en (pérdida) no realizada</b>		<b>(9.646.230)</b>
<b>Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>1.525.606</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		99.564.598
Reembolsos de acciones		(55.076.319)
Dividendos	7	(2.551.179)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>41.937.100</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>549.074.272</b>

### VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	549.074.272	505.611.566	231.720.967

## Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

### ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AEC	10,8438 <sup>1</sup>	10,7710 <sup>1</sup>	10,1688 <sup>1</sup>
Clase AEH	12,2384 <sup>1</sup>	12,0116 <sup>1</sup>	11,0413 <sup>1</sup>
Clase AKH	122,8568 <sup>2</sup>	120,4075 <sup>2</sup>	110,4036 <sup>2</sup>
Clase ANH	10,9076 <sup>3</sup>	10,6766 <sup>3</sup>	9,7591 <sup>3</sup>
Clase AU	13,8379	13,5238	12,3096
Clase AUP	12,3667	12,2255	11,4274
Clase DEC	9,8844 <sup>1</sup>	9,8546 <sup>1</sup>	9,3773 <sup>1</sup>
Clase DEH	11,7082 <sup>1</sup>	11,5352 <sup>1</sup>	10,6831 <sup>1</sup>
Clase DU	12,0562	11,8269	10,8459
Clase DUP	10,9925	10,9155	10,2875
Clase IEC	10,6596 <sup>1</sup>	10,5732 <sup>1</sup>	9,9649 <sup>1</sup>
Clase IEH	12,5634 <sup>1</sup>	12,3172 <sup>1</sup>	11,3035 <sup>1</sup>
Clase IEP	11,6016 <sup>1</sup>	11,3003 <sup>1</sup>	11,3172 <sup>1</sup>
Clase IGC	10,9272 <sup>4</sup>	10,8060 <sup>4</sup>	10,1319 <sup>4</sup>
Clase IGH	13,3620 <sup>4</sup>	13,0594 <sup>4</sup>	11,9152 <sup>4</sup>
Clase IKH	125,9810 <sup>2</sup>	123,3018 <sup>2</sup>	112,7923 <sup>2</sup>
Clase INH	10,9705 <sup>3</sup>	10,7232 <sup>3</sup>	9,7783 <sup>3</sup>
Clase IU	14,1970	13,8609	12,5914
Clase IUP	11,4809	11,3406	10,5721
Clase NEC	10,7405 <sup>1</sup>	10,6452 <sup>1</sup>	10,0163 <sup>1</sup>
Clase NEH	11,4196 <sup>1</sup>	11,1857 <sup>1</sup>	10,2441 <sup>1</sup>
Clase NGC	10,6985 <sup>4</sup>	10,5683 <sup>4</sup>	9,8807 <sup>4</sup>
Clase NGH	11,7770 <sup>4</sup>	11,4987 <sup>4</sup>	10,4701 <sup>4</sup>
Clase NU	12,3486	12,0441	10,9192
Clase NUP	11,5621	11,4076	10,6268
Clase XEH	10,0697 <sup>1</sup>	9,8476 <sup>1</sup>	–
Clase XFH	10,0414 <sup>5</sup>	9,8342 <sup>5</sup>	–
Clase XGH	11,6130 <sup>4</sup>	11,3216 <sup>4</sup>	10,2784 <sup>4</sup>
Clase XU	10,1597	9,8938	–
Clase ZEH	11,5234 <sup>1</sup>	11,2951 <sup>1</sup>	10,3599 <sup>1</sup>
Clase ZFH	9,9878 <sup>5</sup>	9,8121 <sup>5</sup>	–
Clase ZGH	13,3174 <sup>4</sup>	13,0122 <sup>4</sup>	11,8664 <sup>4</sup>
Clase ZU	14,1693	13,8304	12,5574

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

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

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

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

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

## Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

### ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 EUR
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	124.530.178
Efectivo en el banco	2	3.396.633
Por cobrar para la venta de inversiones		1.731.462
Suscripciones por cobrar		12
Interés por cobrar en swaps	2	11.788
Interés y dividendos por cobrar, neto		739.221
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	233.677
Otros activos	20	4.830
<b>Total de activos</b>		<b>130.647.801</b>
<b>Pasivos</b>		
Pagadero por inversiones adquiridas		(2.557.398)
Reembolsos pagaderos		(11.891)
Interés pagadero en swaps	2	(22.354)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(90.902)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(846.716)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(37.776)
Otros pasivos	20	(13.102)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(3.580.139)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>127.067.662</b>

### NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	94.770,796
Clase ANH	825,000
Clase IE	3.014.815,695
Clase IEP	85,000
Clase INH	817,000
Clase XE	84,000
Clase XFH	92,000
Clase XGH	72,000
Clase XUH	100,000
Clase ZE	78,000
Clase ZFH	92,000
Clase 1E	6.619.243,532
Clase 1G	212.694,049
Clase 2E	3.591.152,015
Clase 2G	69,000
Clase 3G	680.760,993
Clase 4E	236.424,367
Clase 4G	2.978.486,751
Clase 8E	921.279,058
Clase 8G	110.626,447
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 2021

	Notas	2021 EUR
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>157.999.564</b>
<b>Ingresos</b>		
Interés sobre bonos, neto	2	997.516
Interés bancario	2	18
Ingresos por intereses en swaps		12.214
<b>Total de ingresos</b>		<b>1.009.748</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(260.978)
Interés bancario	2	(12.454)
Gastos por intereses en swaps		(180.626)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(2.115)
Gastos operativos	3, 5	(88.875)
<b>Total de gastos</b>		<b>(545.048)</b>
<b>Ingresos netos de inversiones</b>		
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		1.512.590
Ganancia neta realizada en swaps		52.329
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(95.526)
(Pérdida) neta realizada en contratos de futuros		(226.196)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		8.471
<b>Ganancia neta realizada</b>		<b>1.251.668</b>
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(1.484.332)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en swaps		(66.075)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		15.307
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		84.372
<b>Cambio neto en (pérdida) no realizada</b>		<b>(1.450.728)</b>
<b>Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>265.640</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		2.371.901
Reembolsos de acciones		(33.569.437)
Dividendos	7	(6)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>(31.197.542)</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>127.067.662</b>

### VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
EUR	127.067.662	157.999.564	127.139.343



## Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

### ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AE	10,7787	10,7975	9,9041
Clase ANH	10,4241 <sup>1</sup>	10,4217 <sup>1</sup>	9,4949 <sup>1</sup>
Clase IE	10,9726	10,9588	9,9912
Clase IEP <sup>#</sup>	9,9132	—	—
Clase INH	10,5460 <sup>1</sup>	10,5063 <sup>1</sup>	9,5194 <sup>1</sup>
Clase XE	10,1440	10,1073	—
Clase XFH	10,1142 <sup>2</sup>	10,0938 <sup>2</sup>	—
Clase XGH	10,1951 <sup>3</sup>	10,1315 <sup>3</sup>	—
Clase XUH	10,2142 <sup>4</sup>	10,1441 <sup>4</sup>	—
Clase ZE	10,9309	10,9309	9,9786
Clase ZFH	10,0654 <sup>2</sup>	10,0801 <sup>2</sup>	—
Clase 1E	1,4703	1,4728	1,3507
Clase 1G	1,1632 <sup>3</sup>	1,1548 <sup>3</sup>	1,1002 <sup>3</sup>
Clase 2E	10,9838	10,9688	9,9984
Clase 2G	10,4994 <sup>3</sup>	10,3939 <sup>3</sup>	9,8457 <sup>3</sup>
Clase 3G	1,3068 <sup>3</sup>	1,2941 <sup>3</sup>	1,2267 <sup>3</sup>
Clase 4E	11,0636	11,0208	—
Clase 4G	10,9491 <sup>3</sup>	10,8094 <sup>3</sup>	10,1845 <sup>3</sup>
Clase 8E	1,8405	1,8383	1,6764
Clase 8G	1,5837 <sup>3</sup>	1,5677 <sup>3</sup>	1,4850 <sup>3</sup>
Clase 9G	10,4779 <sup>3</sup>	10,3783 <sup>3</sup>	9,8373 <sup>3</sup>

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

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

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

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

<sup>#</sup> Consulte la nota 1.

## Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

### ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 EUR
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	549.347.382
Efectivo en el banco	2	4.067.748
Por cobrar para la venta de inversiones		8.360.946
Suscripciones por cobrar		185.693
Interés y dividendos por cobrar, neto		6.542.921
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	397.269
<b>Total de activos</b>		<b>568.901.959</b>
<b>Pasivos</b>		
Pagadero por inversiones adquiridas		(8.198.374)
Reembolsos pagaderos		(13.006.256)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(375.557)
Otros pasivos	20	(81.537)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(21.661.724)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>547.240.235</b>

### NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	75,000
Clase AKH	81,000
Clase ANH	807,000
Clase IE	7.673.539,250
Clase IEP	5.126.247,644
Clase IKH	80,000
Clase INH	798,000
Clase XE	77,000
Clase ZE	203.866,677
Clase ZEP	473.149,000
Clase 1E	14.692.384,508
Clase 1EP	1.305.814,987
Clase 1G	292.244,360
Clase 1GP	23.678,594
Clase 1UT	287.966,873
Clase 2E	2.008.348,000
Clase 2EP	84,000
Clase 2FH	6.834,346
Clase 2G	68,000
Clase 2GP	75,000
Clase 3E	3.571.829,140
Clase 3EP	2.432.223,077
Clase 3FC	13.176,825
Clase 3FH	39.078,671
Clase 3G	921.485,349
Clase 3GP	111.659,650
Clase 4E	194.671,093
Clase 4G	1.826.379,501
Clase 8E	2.460.622,223
Clase 8EP	5.555.524,634
Clase 8FH	32.415,940
Clase 8G	10.635,667
Clase 8GP	5.347,069
Clase 9E	376.347,660
Clase 9EP	7.573,873
Clase 9FC	92,741
Clase 9FH	2.306,914
Clase 9G	67,000
Clase 9GP	75,000

### ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 EUR
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>601.800.632</b>
<b>Ingresos</b>		
Dividendos, neto	2	48
Interés sobre bonos, neto	2	10.790.559
Interés bancario	2	390
<b>Total de ingresos</b>		<b>10.790.997</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(2.275.128)
Interés bancario	2	(10.481)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(4.805)
Gastos operativos	3, 5	(478.237)
<b>Total de gastos</b>		<b>(2.768.651)</b>
<b>Ingresos netos de inversiones</b>		<b>8.022.346</b>
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		4.683.218
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		54.752
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		47.660
<b>Ganancia neta realizada</b>		<b>4.785.630</b>
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(4.580.545)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		758.517
<b>Cambio neto en (pérdida) no realizada</b>		<b>(3.822.028)</b>
<b>Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>8.985.948</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		50.256.064
Reembolsos de acciones		(113.759.647)
Dividendos	7	(42.762)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>(63.546.345)</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>547.240.235</b>

### VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
EUR	547.240.235	601.800.632	476.354.207

## Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

### ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AE	11,3483	11,2181	–
Clase AKH	106,2903 <sup>1</sup>	104,9357 <sup>1</sup>	88,6643 <sup>1</sup>
Clase ANH	10,6972 <sup>2</sup>	10,5488 <sup>2</sup>	8,8954 <sup>2</sup>
Clase IE	11,3417	11,1683	9,3892
Clase IEP	10,1450	9,9899	8,7058
Clase IKH	107,6392 <sup>1</sup>	105,8588 <sup>1</sup>	88,9089 <sup>1</sup>
Clase INH	10,8393 <sup>2</sup>	10,6479 <sup>2</sup>	8,9222 <sup>2</sup>
Clase XE	11,0200	10,8140	9,0281
Clase ZE	11,3197	11,1495	9,3780
Clase ZEP	10,1258	9,9735	8,7007
Clase 1E	11,1577	11,0164	9,3105
Clase 1EP	9,9838	9,8573	8,6466
Clase 1G	10,6587 <sup>3</sup>	10,4297 <sup>3</sup>	9,1568 <sup>3</sup>
Clase 1GP	9,5625 <sup>3</sup>	9,3569 <sup>3</sup>	8,5225 <sup>3</sup>
Clase 1UT	10,4578 <sup>4</sup>	10,4752 <sup>4</sup>	9,1107 <sup>4</sup>
Clase 2E	11,3514	11,1761	9,3929
Clase 2EP	10,1849	10,0267	8,7357
Clase 2FH	11,2171 <sup>5</sup>	11,0615 <sup>5</sup>	9,3252 <sup>5</sup>
Clase 2G	10,8460 <sup>3</sup>	10,5872 <sup>3</sup>	9,2443 <sup>3</sup>
Clase 2GP	9,7385 <sup>3</sup>	9,4995 <sup>3</sup>	8,5956 <sup>3</sup>
Clase 3E	11,3717	11,1933	9,4027
Clase 3EP	10,2486	10,0878	8,7895
Clase 3FC	10,0724 <sup>5</sup>	9,9302 <sup>5</sup>	8,6906 <sup>5</sup>
Clase 3FH	11,2347 <sup>5</sup>	11,0760 <sup>5</sup>	9,3331 <sup>5</sup>
Clase 3G	10,8623 <sup>3</sup>	10,5964 <sup>3</sup>	9,2468 <sup>3</sup>
Clase 3GP	9,6698 <sup>3</sup>	9,4331 <sup>3</sup>	8,5390 <sup>3</sup>
Clase 4E	11,6186	11,3964	9,5067
Clase 4G	11,3532 <sup>3</sup>	11,0365 <sup>3</sup>	9,5632 <sup>3</sup>
Clase 4GP	–	–	8,7170 <sup>3</sup>
Clase 8E	11,3369	11,1642	9,3866
Clase 8EP	10,1875	10,0322	8,7498
Clase 8FH	11,2019 <sup>5</sup>	11,0486 <sup>5</sup>	9,3179 <sup>5</sup>
Clase 8G	10,8322 <sup>3</sup>	10,5718 <sup>3</sup>	9,2336 <sup>3</sup>
Clase 8GP	9,7303 <sup>3</sup>	9,4964 <sup>3</sup>	8,6037 <sup>3</sup>
Clase 9E	11,3826	11,2018	9,4061
Clase 9EP	10,2622	10,0992	8,7964
Clase 9FC	10,1478 <sup>5</sup>	10,0032 <sup>5</sup>	8,7510 <sup>5</sup>
Clase 9FH	11,2530 <sup>5</sup>	11,0918 <sup>5</sup>	9,3420 <sup>5</sup>
Clase 9G	10,8886 <sup>3</sup>	10,6161 <sup>3</sup>	9,2545 <sup>3</sup>
Clase 9GP	9,7567 <sup>3</sup>	9,5122 <sup>3</sup>	8,6021 <sup>3</sup>

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

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

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

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

<sup>5</sup> 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 2021

	Notas	2021 EUR
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	100.600.922
Efectivo en el banco	2	2.159.827
Interés por cobrar en swaps	2	1.884
Interés y dividendos por cobrar, neto		1.125.869
Ganancia neta no realizada en swaps	2, 10	38.046
<b>Total de activos</b>		<b>103.926.548</b>
<b>Pasivos</b>		
Pagadero por inversiones adquiridas		(648.960)
Reembolsos pagaderos		(4.731)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(623.118)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(1.310)
Otros pasivos	20	(8.470)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(1.286.589)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>102.639.959</b>

### NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	2.426,182
Clase AEP	167,669
Clase AKH	82,000
Clase ANH	82,000
Clase IE	34.835,871
Clase IEP	9,000
Clase IGC	8,000
Clase IGH	7,000
Clase IKH	82,000
Clase INH	816,000
Clase XE	37.800,539
Clase XGC	71.793,472
Clase XGH	689.374,273
Clase ZE	8,200

### ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AE	104,3434	103,3869	89,6665
Clase AEP	98,2171	97,3234	87,4074
Clase AKH	104,8086 <sup>1</sup>	103,6634 <sup>1</sup>	89,7046 <sup>1</sup>
Clase ANH	106,1116 <sup>2</sup>	104,8255 <sup>2</sup>	90,4760 <sup>2</sup>
Clase IE	105,2684	104,0942	89,9208
Clase IEP	99,0533	97,9620	87,6410
Clase IGC	100,5255 <sup>3</sup>	99,1215 <sup>3</sup>	88,1422 <sup>3</sup>
Clase IGH	106,5476 <sup>3</sup>	105,0674 <sup>3</sup>	90,3604 <sup>3</sup>
Clase IKH	105,1598 <sup>1</sup>	103,8150 <sup>1</sup>	89,4959 <sup>1</sup>
Clase INH	10,6014 <sup>2</sup>	10,4542 <sup>2</sup>	8,9899 <sup>2</sup>
Clase XE	106,2043	104,8093	90,1780
Clase XGC	101,2661 <sup>3</sup>	99,6631 <sup>3</sup>	88,3048 <sup>3</sup>
Clase XGH	107,5057 <sup>3</sup>	105,8053 <sup>3</sup>	90,6104 <sup>3</sup>
Clase ZE	105,1451	104,0037	89,8970

<sup>1</sup> La clase está denominada en SEK. La divisa base de la Cartera es el EUR.<sup>2</sup> La clase está denominada en NOK. La divisa base de la Cartera es el EUR.<sup>3</sup> 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 2021

	Notas	2021 EUR
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>87.774.729</b>
<b>Ingresos</b>		
Interés sobre bonos, neto	2	1.725.252
Interés bancario	2	163
Ingresos por intereses en swaps		31.347
<b>Total de ingresos</b>		<b>1.756.762</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(6.568)
Interés bancario	2	(4.844)
Gastos operativos	3, 5	(49.001)
<b>Total de gastos</b>		<b>(60.413)</b>
<b>Ingresos netos de inversiones</b>		<b>1.696.349</b>
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(182.603)
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		1.189.171
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		6.199
<b>Ganancia neta realizada</b>		<b>1.012.767</b>
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(437.729)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en swaps		(25.755)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(1.486.923)
<b>Cambio neto en (pérdida) no realizada</b>		<b>(1.950.407)</b>
<b>Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>758.709</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		15.243.413
Reembolsos de acciones		(1.136.892)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>14.106.521</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>102.639.959</b>

### VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
EUR	102.639.959	87.774.729	46.407.346

## Threadneedle (Lux) - European Social Bond

### ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 EUR
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	384.184.758
Efectivo en el banco	2	1.371.509
Suscripciones por cobrar		812.701
Interés y dividendos por cobrar, neto		1.940.279
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	653.669
<b>Total de activos</b>		<b>388.962.916</b>
<b>Pasivos</b>		
Pagadero por inversiones adquiridas		(451.244)
Reembolsos pagaderos		(94.506)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(204.410)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(100.676)
Otros pasivos	20	(38.289)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(889.125)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>388.073.791</b>

### NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	1.554.973,127
Clase AEP	44.986,000
Clase AFH	93,000
Clase AKH	86,000
Clase ANH	861,000
Clase ASC	100,000
Clase ASH	100,000
Clase AUC	100,000
Clase AUH	100,000
Clase ID	22.738.015,068
Clase IE	5.308.076,449
Clase IEP	3.300.517,175
Clase IFH	2.028.612,000
Clase IGH	351,000
Clase IKH	85,000
Clase INH	839,000
Clase ISC	100,000
Clase ISH	100,000
Clase IUC	27.364,458
Clase IUH	100,000
Clase LE	3.939.441,429
Clase NEP	97.524,873
Clase ZD	9.560.412,625
Clase ZE	3.400.557,593
Clase ZEP	499.117,379
Clase ZFH	35.589,000
Clase ZGC	2.209.355,944
Clase ZGH	541.074,704
Clase ZUH	1.505,141

### ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 EUR
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>329.896.379</b>
<b>Ingresos</b>		
Interés sobre bonos, neto	2	1.941.159
Interés bancario	2	116
<b>Total de ingresos</b>		<b>1.941.275</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(571.945)
Interés bancario	2	(11.285)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(2.746)
Gastos operativos	3, 5	(210.989)
<b>Total de gastos</b>		<b>(796.965)</b>
<b>Ingresos netos de inversiones</b>		<b>1.144.310</b>
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(981.785)
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		97.916
(Pérdida) neta realizada en contratos de futuros		(319.802)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		340.674
<b>(Pérdida) neta realizada</b>		<b>(862.997)</b>
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(931.558)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(45.810)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		433.483
<b>Cambio neto en (pérdida) no realizada</b>		<b>(543.885)</b>
<b>(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>(262.572)</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		103.410.301
Reembolsos de acciones		(44.150.621)
Dividendos	7	(819.696)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>58.439.984</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>388.073.791</b>

### VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
EUR	388.073.791	329.896.379	154.103.742

## Threadneedle (Lux) - European Social Bond

### ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AE	9,9665	9,9729	—
Clase AEP	9,8553	9,9137	—
Clase AFH	9,9566 <sup>1</sup>	9,9710 <sup>1</sup>	—
Clase AKH	99,7063 <sup>2</sup>	99,5278 <sup>2</sup>	—
Clase ANH	10,0068 <sup>3</sup>	9,9762 <sup>3</sup>	—
Clase ASC	9,9449 <sup>4</sup>	9,9703 <sup>4</sup>	—
Clase ASH	10,0046 <sup>4</sup>	9,9784 <sup>4</sup>	—
Clase AUC	9,9482 <sup>5</sup>	9,9704 <sup>5</sup>	—
Clase AUH	10,0165 <sup>5</sup>	9,9792 <sup>5</sup>	—
Clase ID	10,0867 <sup>6</sup>	10,0874 <sup>6</sup>	9,5778 <sup>6</sup>
Clase IE	10,7571	10,7559	10,1785
Clase IEP	10,1580	10,2088	9,7761
Clase IFH	10,4745 <sup>1</sup>	10,4909 <sup>1</sup>	9,9642 <sup>1</sup>
Clase IGH	10,0079 <sup>7</sup>	9,9775 <sup>7</sup>	—
Clase IKH	100,9628 <sup>2</sup>	100,7592 <sup>2</sup>	95,0380 <sup>2</sup>
Clase INH	10,2669 <sup>3</sup>	10,2330 <sup>3</sup>	9,6122 <sup>3</sup>
Clase ISC	9,9457 <sup>4</sup>	9,9703 <sup>4</sup>	—
Clase ISH	10,0055 <sup>4</sup>	9,9784 <sup>4</sup>	—
Clase IUC	9,9514 <sup>5</sup>	9,9711 <sup>5</sup>	—
Clase IUH	10,0209 <sup>5</sup>	9,9799 <sup>5</sup>	—
Clase LE	10,7906	10,7895	10,2060
Clase NEP	1023,4703	1028,6742	984,7206
Clase ZD	10,0744 <sup>6</sup>	10,0776 <sup>6</sup>	9,5733 <sup>6</sup>
Clase ZE	10,7275	10,7290	10,1580
Clase ZEP	10,1072	10,1616	9,7334
Clase ZFH	10,4635 <sup>1</sup>	10,4827 <sup>1</sup>	9,9581 <sup>1</sup>
Clase ZGC	10,4652 <sup>7</sup>	10,4934 <sup>7</sup>	—
Clase ZGH	10,6485 <sup>7</sup>	10,6218 <sup>7</sup>	—
Clase ZUH	10,2796 <sup>5</sup>	10,2472 <sup>5</sup>	—

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

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

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

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

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

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

<sup>7</sup> 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 2021

	Notas	2021 EUR
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	213.424.713
Efectivo en el banco	2	13.006.312
Por cobrar para la venta de inversiones		2.169.709
Suscripciones por cobrar		452.290
Interés por cobrar en swaps	2	47.899
Interés y dividendos por cobrar, neto		2.024.042
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	708
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	1.852.893
<b>Total de activos</b>		<b>232.978.566</b>
<b>Pasivos</b>		
Pagadero por inversiones adquiridas		(4.202.541)
Reembolsos pagaderos		(359.719)
Interés pagadero en swaps	2	(108.244)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(4.416.160)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(168.735)
Otros pasivos	20	(41.325)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(9.296.724)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>223.681.842</b>

### NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	2.957.517,633
Clase AEP	726.933,044
Clase AKH	81,000
Clase ANH	802,000
Clase AUH	86,000
Clase DE	1.321.655,631
Clase DEP	1.821.881,560
Clase DUH	87,000
Clase IE	1.926.682,604
Clase INH	792,000

### ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AE	31,2041	31,0867	27,7686
Clase AEP	15,2609	15,3978	14,1492
Clase AKH	106,3216 <sup>1</sup>	105,8567 <sup>1</sup>	94,4608 <sup>1</sup>
Clase ANH	10,7451 <sup>2</sup>	10,6864 <sup>2</sup>	9,5087 <sup>2</sup>
Clase AUH	11,7582 <sup>3</sup>	11,6784 <sup>3</sup>	10,3501 <sup>3</sup>
Clase DE	29,1665	29,1371	26,1701
Clase DEP	11,4180	11,5522	10,6750
Clase DUH	11,5189 <sup>3</sup>	11,4774 <sup>3</sup>	10,2405 <sup>3</sup>
Clase IE	31,6332	31,4196	27,8985
Clase INH	10,9100 <sup>2</sup>	10,8071 <sup>2</sup>	9,5432 <sup>2</sup>
Clase W	—	—	58,8490

<sup>1</sup> La clase está denominada en SEK. La divisa base de la Cartera es el EUR.<sup>2</sup> La clase está denominada en NOK. La divisa base de la Cartera es el EUR.<sup>3</sup> 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 2021

	Notas	2021 EUR
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>234.144.701</b>
<b>Ingresos</b>		
Interés sobre bonos, neto	2	2.947.223
Interés bancario	2	378
Ingresos por intereses en swaps		115.297
<b>Total de ingresos</b>		<b>3.062.898</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.027.269)
Interés bancario	2	(30.241)
Gastos por intereses en swaps		(1.036.463)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(14.436)
Gastos operativos	3, 5	(254.080)
<b>Total de gastos</b>		<b>(2.362.489)</b>
<b>Ingresos netos de inversiones</b>		
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		1.106.929
Ganancia neta realizada en swaps		835.521
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(1.525.791)
(Pérdida) neta realizada en contratos de futuros		(1.339.030)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(204.094)
<b>(Pérdida) neta realizada</b>		<b>(1.126.465)</b>
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(704.618)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en swaps		(818.723)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		1.636.372
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		1.248.448
<b>Cambio neto en ganancia no realizada</b>		<b>1.361.479</b>
<b>Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>935.423</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		43.110.026
Reembolsos de acciones		(54.111.175)
Dividendos	7	(397.133)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>(11.398.282)</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>223.681.842</b>

### VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
EUR	223.681.842	234.144.701	165.029.205

## Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

## ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 USD
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	49.523.414
Efectivo en el banco	2	1.146.401
Suscripciones por cobrar		47.372
Interés y dividendos por cobrar, neto		510.936
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	89.164
<b>Total de activos</b>		<b>51.317.287</b>
<b>Pasivos</b>		
Reembolsos pagaderos		(51.067)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(731.609)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(46.731)
Otros pasivos	20	(11.306)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(840.713)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>50.476.574</b>

## NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	495.559,570
Clase AEH	267.484,861
Clase AKH	80,000
Clase ANH	792,000
Clase ASH	8.183,861
Clase AU	116.557,478
Clase AUP	769.431,620
Clase DEC	49.616,968
Clase DEH	140.092,003
Clase DU	229.029,854
Clase IEC	305.086,000
Clase IEH	407.992,116
Clase IU	2.093,260
Clase W	6.537,236
Clase WEH	7.298,489
Clase XUP	85,000

## ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AEC	12,8286 <sup>1</sup>	12,9505 <sup>1</sup>	11,4485 <sup>1</sup>
Clase AEH	22,7652 <sup>1</sup>	22,5246 <sup>1</sup>	19,0129 <sup>1</sup>
Clase AKH	107,3149 <sup>2</sup>	105,9916 <sup>2</sup>	89,1452 <sup>2</sup>
Clase ANH	10,8384 <sup>3</sup>	10,6943 <sup>3</sup>	8,9692 <sup>3</sup>
Clase ASH	15,1515 <sup>4</sup>	14,9331 <sup>4</sup>	12,5045 <sup>4</sup>
Clase AU	24,1455	23,7934	19,8691
Clase AUP	8,2757	8,3207	7,2747
Clase DEC	9,2955 <sup>1</sup>	9,3896 <sup>1</sup>	8,3093 <sup>1</sup>
Clase DEH	17,4682 <sup>1</sup>	17,2924 <sup>1</sup>	14,6111 <sup>1</sup>
Clase DU	18,8064	18,5415	15,4989
Clase IEC	9,7229 <sup>1</sup>	9,7778 <sup>1</sup>	-
Clase IEH	32,2082 <sup>1</sup>	31,7423 <sup>1</sup>	26,5802 <sup>1</sup>
Clase IU	12,3201	12,0940	10,0191
Clase W	33,0371	32,4983	27,0437
Clase WEH	22,2783 <sup>1</sup>	22,0058 <sup>1</sup>	18,5115 <sup>1</sup>
Clase XUP	11,7625	11,7343	10,0921

<sup>1</sup> La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.<sup>2</sup> La clase está denominada en SEK. La divisa base de la Cartera es el USD.<sup>3</sup> La clase está denominada en NOK. La divisa base de la Cartera es el USD.<sup>4</sup> 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 2021

	Notas	2021 USD
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>47.451.659</b>
<b>Ingresos</b>		
Dividendos, neto	2	971
Interés sobre bonos, neto	2	1.002.693
Interés bancario	2	250
<b>Total de ingresos</b>		<b>1.003.914</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(286.502)
Interés bancario	2	(20)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(20)
Gastos operativos	3, 5	(67.955)
<b>Total de gastos</b>		<b>(354.497)</b>
<b>Ingresos netos de inversiones</b>		<b>649.417</b>
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		351.813
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(523.241)
(Pérdida) neta realizada en contratos de futuros		(22.723)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(32.736)
<b>(Pérdida) neta realizada</b>		<b>(226.887)</b>
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(211.501)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(260.759)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		89.164
<b>Cambio neto en (pérdida) no realizada</b>		<b>(383.096)</b>
<b>Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>39.434</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		7.947.485
Reembolsos de acciones		(4.604.571)
Dividendos	7	(357.433)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>2.985.481</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>50.476.574</b>

## VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	50.476.574	47.451.659	33.146.518



## Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

## ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 USD
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	41.100.336
Efectivo en el banco	2	1.537.484
Suscripciones por cobrar		2.611
Interés y dividendos por cobrar, neto		498.539
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	64.969
<b>Total de activos</b>		<b>43.203.939</b>
<b>Pasivos</b>		
Reembolsos pagaderos		(73.689)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(37.310)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(48.769)
Otros pasivos	20	(10.879)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(170.647)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>43.033.292</b>

## NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	70.357,901
Clase AEH	16.434,304
Clase AKH	82,000
Clase ANH	818,000
Clase ASH	5.158,612
Clase AU	55.178,259
Clase AUP	2.948.773,338
Clase DEH	12.529,970
Clase DU	21.781,309
Clase IEH	21.782,572
Clase IU	89,000
Clase SU	673,658
Clase SUP	50.594,368
Clase W	8.433,618
Clase XUP	89,000
Clase ZU	76,000

## ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AEC	9,2657 <sup>1</sup>	9,2177 <sup>1</sup>	8,1700 <sup>1</sup>
Clase AEH	27,6005 <sup>1</sup>	26,8384 <sup>1</sup>	22,6402 <sup>1</sup>
Clase AKH	103,6967 <sup>2</sup>	100,7566 <sup>2</sup>	84,8443 <sup>2</sup>
Clase ANH	10,4424 <sup>3</sup>	10,1328 <sup>3</sup>	8,5211 <sup>3</sup>
Clase ASH	13,0233 <sup>4</sup>	12,6134 <sup>4</sup>	10,5597 <sup>4</sup>
Clase AU	81,7866	79,1694	66,0483
Clase AUP	11,4294	11,3182	9,9193
Clase DEH	20,5023 <sup>1</sup>	19,9465 <sup>1</sup>	16,8452 <sup>1</sup>
Clase DU	58,1329	56,3008	47,0167
Clase IEH	30,3161 <sup>1</sup>	29,3633 <sup>1</sup>	24,5729 <sup>1</sup>
Clase IU	11,2456	10,8581	9,0048
Clase SU	32,8195	31,7934	26,5644
Clase SUP	10,9823	10,8819	9,5489
Clase W	68,1919	65,8940	54,7816
Clase XUP	11,0870	10,9029	9,3824
Clase ZU	13,1387	12,6758	10,4968

<sup>1</sup> La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.<sup>2</sup> La clase está denominada en SEK. La divisa base de la Cartera es el USD.<sup>3</sup> La clase está denominada en NOK. La divisa base de la Cartera es el USD.<sup>4</sup> 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 2021

	Notas	2021 USD
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>45.515.822</b>
<b>Ingresos</b>		
Dividendos, neto	2	369
Interés sobre bonos, neto	2	1.025.715
Interés bancario	2	152
<b>Total de ingresos</b>		<b>1.026.236</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(305.097)
Interés bancario	2	(100)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(17)
Gastos operativos	3, 5	(67.959)
<b>Total de gastos</b>		<b>(373.173)</b>
<b>Ingresos netos de inversiones</b>		
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		223.388
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(27.285)
(Pérdida) neta realizada en contratos de futuros		(24.506)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(3.111)
<b>Ganancia neta realizada</b>		<b>168.486</b>
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		604.830
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(8.626)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		64.969
<b>Cambio neto en ganancia no realizada</b>		<b>661.173</b>
<b>Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>1.482.722</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		281.333
Reembolsos de acciones		(3.407.683)
Dividendos	7	(838.902)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>(3.965.252)</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>43.033.292</b>

## VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	43.033.292	45.515.822	45.432.000

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

## ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 USD
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	103.599.704
Efectivo en el banco	2	5.160.588
Suscripciones por cobrar		791
Interés y dividendos por cobrar, neto		1.272.170
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	37.813
<b>Total de activos</b>		<b>110.071.066</b>
<b>Pasivos</b>		
Reembolsos pagaderos		(1.133.766)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(717.617)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(57.977)
Otros pasivos	20	(20.217)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(1.929.577)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>108.141.489</b>

## NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	2.558.999,677
Clase AEH	184.097,816
Clase AKH	85,000
Clase ANH	835,000
Clase ASC	141.035,682
Clase ASH	20.631,146
Clase AU	658.591,868
Clase AUP	1.573.844,274
Clase DEH	128.375,963
Clase DU	142.725,540
Clase IE	85.348,303
Clase IEH	717.330,047
Clase XU	3.441.839,392
Clase XUP	787.441,055
Clase ZEH	21.244,600

## ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AEC	5,2370 <sup>1</sup>	5,3304 <sup>1</sup>	4,8028 <sup>1</sup>
Clase AEH	15,4196 <sup>1</sup>	15,3274 <sup>1</sup>	13,1271 <sup>1</sup>
Clase AKH	101,1453 <sup>2</sup>	100,3800 <sup>2</sup>	85,8647 <sup>2</sup>
Clase ANH	10,2578 <sup>3</sup>	10,1668 <sup>3</sup>	8,6667 <sup>3</sup>
Clase ASC	7,1342 <sup>4</sup>	7,2335 <sup>4</sup>	6,4712 <sup>4</sup>
Clase ASH	11,5541 <sup>4</sup>	11,4387 <sup>4</sup>	9,7217 <sup>4</sup>
Clase AU	18,7665	18,5735	15,7370
Clase AUP	5,5758	5,6508	5,0421
Clase DEH	12,0047 <sup>1</sup>	11,9416 <sup>1</sup>	10,2427 <sup>1</sup>
Clase DU	14,5957	14,4565	12,2671
Clase IE	10,1060 <sup>1</sup>	9,8260 <sup>1</sup>	8,8511 <sup>1</sup>
Clase IEH	17,6735 <sup>1</sup>	17,5011 <sup>1</sup>	14,8774 <sup>1</sup>
Clase XU	11,5656	11,3638	9,4901
Clase XUP	9,6746	9,7360	8,5602
Clase ZEH	11,3450 <sup>1</sup>	11,2373 <sup>1</sup>	9,5569 <sup>1</sup>

<sup>1</sup> La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.<sup>2</sup> La clase está denominada en SEK. La divisa base de la Cartera es el USD.<sup>3</sup> La clase está denominada en NOK. La divisa base de la Cartera es el USD.<sup>4</sup> 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 2021

	Notas	2021 USD
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>115.675.743</b>
<b>Ingresos</b>		
Dividendos, neto	2	1.727
Interés sobre bonos, neto	2	2.604.558
Interés bancario	2	258
<b>Total de ingresos</b>		<b>2.606.543</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(368.140)
Interés bancario	2	(30)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(47)
Gastos operativos	3, 5	(125.259)
<b>Total de gastos</b>		<b>(493.476)</b>
<b>Ingresos netos de inversiones</b>		<b>2.113.067</b>
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		122.376
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(352.010)
(Pérdida) neta realizada en contratos de futuros		(88.742)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(16.791)
<b>(Pérdida) neta realizada</b>		<b>(335.167)</b>
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(483.612)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(120.216)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de futuros		(11.961)
<b>Cambio neto en (pérdida) no realizada</b>		<b>(615.789)</b>
<b>Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>1.162.111</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		4.789.509
Reembolsos de acciones		(12.630.547)
Dividendos	7	(855.327)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>(8.696.365)</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>108.141.489</b>

## VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	108.141.489	115.675.743	107.744.487

## Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

### ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 USD
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	186.714.332
Efectivo en el banco	2	4.316.937
Por cobrar para la venta de inversiones		993.929
Suscripciones por cobrar		654
Interés y dividendos por cobrar, neto		2.428.906
<b>Total de activos</b>		<b>194.454.758</b>
<b>Pasivos</b>		
Pagadero por inversiones adquiridas		(3.209.295)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(1.570.160)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(95.058)
Otros pasivos	20	(18.609)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(4.893.122)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>189.561.636</b>

### NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	29.470,445
Clase AEH	20.747,014
Clase AKH	80,000
Clase ANH	802,000
Clase ASH	38.822,044
Clase AU	102.867,427
Clase AUP	263.074,862
Clase DEC	29.851,757
Clase DEH	28.236,180
Clase DU	55.590,628
Clase IEC	92,000
Clase IEH	1.970.528,105
Clase IKH	79,000
Clase INH	789,000
Clase ISC	135,000
Clase IU	7.997.494,297
Clase TEH	3.547,580
Clase XUP	90,000
Clase ZFH	82,000
Clase ZGH	58,000
Clase ZU	199.856,310

### ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 USD
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>210.577.608</b>
<b>Ingresos</b>		
Interés sobre bonos, neto	2	5.424.604
Interés bancario	2	917
<b>Total de ingresos</b>		<b>5.425.521</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(629.881)
Interés bancario	2	(3)
Gastos operativos	3, 5	(124.915)
<b>Total de gastos</b>		<b>(754.799)</b>
<b>Ingresos netos de inversiones</b>		<b>4.670.722</b>
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		2.951.682
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(1.017.407)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(20.118)
<b>Ganancia neta realizada</b>		<b>1.914.157</b>
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(534.564)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(456.756)
<b>Cambio neto en (pérdida) no realizada</b>		<b>(991.320)</b>
<b>Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>5.593.559</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		17.318.863
Reembolsos de acciones		(43.807.990)
Dividendos	7	(120.404)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>(26.609.531)</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>189.561.636</b>

### VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	189.561.636	210.577.608	109.192.138

## Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

### ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AEC	12,488 <sup>1</sup>	12,510 <sup>1</sup>	11,193 <sup>1</sup>
Clase AEH	33,545 <sup>1</sup>	32,734 <sup>1</sup>	27,775 <sup>4</sup>
Clase AKH	107,332 <sup>2</sup>	104,542 <sup>2</sup>	88,545 <sup>2</sup>
Clase ANH	10,777 <sup>3</sup>	10,486 <sup>3</sup>	8,865 <sup>3</sup>
Clase ASH	15,743 <sup>4</sup>	15,300 <sup>4</sup>	12,884 <sup>4</sup>
Clase AU	39,449 <sup>3</sup>	38,328 <sup>3</sup>	32,152 <sup>3</sup>
Clase AUP	13,414 <sup>3</sup>	13,380 <sup>3</sup>	11,832 <sup>3</sup>
Clase DEC	9,419 <sup>1</sup>	9,447 <sup>1</sup>	8,464 <sup>1</sup>
Clase DEH	24,140 <sup>1</sup>	23,579 <sup>1</sup>	20,046 <sup>1</sup>
Clase DU	28,340 <sup>3</sup>	27,563 <sup>3</sup>	23,167 <sup>3</sup>
Clase IEC	9,176 <sup>1</sup>	9,154 <sup>1</sup>	8,121 <sup>1</sup>
Clase IEH	33,461 <sup>1</sup>	32,506 <sup>1</sup>	27,336 <sup>4</sup>
Clase IKH	109,271 <sup>2</sup>	105,975 <sup>2</sup>	88,941 <sup>2</sup>
Clase INH	10,980 <sup>3</sup>	10,637 <sup>3</sup>	8,907 <sup>3</sup>
Clase ISC <sup>4</sup>	9,971 <sup>2</sup>	—	—
Clase IU	12,286 <sup>4</sup>	11,883 <sup>4</sup>	9,875 <sup>4</sup>
Clase TEH	11,943 <sup>1</sup>	11,603 <sup>1</sup>	9,760 <sup>1</sup>
Clase XUP	11,108 <sup>3</sup>	10,996 <sup>3</sup>	9,603 <sup>3</sup>
Clase ZFH	11,382 <sup>5</sup>	11,091 <sup>5</sup>	9,376 <sup>5</sup>
Clase ZGH	12,581 <sup>6</sup>	12,202 <sup>6</sup>	10,239 <sup>6</sup>
Clase ZU	14,331 <sup>8</sup>	13,879 <sup>8</sup>	11,567 <sup>8</sup>

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

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

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

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

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

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

<sup>8</sup> Consulte la nota 1.

## Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

### ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 USD
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	63.554.536
Efectivo en el banco	2	923.430
Suscripciones por cobrar		21.584
Interés y dividendos por cobrar, neto		623.075
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	44.172
<b>Total de activos</b>		<b>65.166.797</b>
<b>Pasivos</b>		
Reembolsos pagaderos		(60.301)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(396.849)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(17.185)
Otros pasivos	20	(9.391)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(483.726)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>64.683.071</b>

### NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	99.846,014
Clase AKH	82,000
Clase AS	673,367
Clase ASC	3.127,939
Clase ASH	36.956,696
Clase AU	140.194,518
Clase AUP	888.473,141
Clase AVC	100,000
Clase AVH	100,000
Clase DEH	44.715,521
Clase IEH	1.132.906,045
Clase IGH	54,000
Clase ISH	97,000
Clase IU	41.197,659
Clase XU	2.389.924,753
Clase ZU	42.070,000
Clase ZUP	92,000

### ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AEH	12,129 <sup>1</sup>	11,960 <sup>1</sup>	10,523 <sup>1</sup>
Clase AKH	104,528 <sup>2</sup>	102,872 <sup>2</sup>	90,257 <sup>2</sup>
Clase AS	11,979 <sup>3</sup>	11,642 <sup>3</sup>	10,739 <sup>3</sup>
Clase ASC	10,867 <sup>3</sup>	10,864 <sup>3</sup>	9,864 <sup>3</sup>
Clase ASH	13,370 <sup>3</sup>	13,132 <sup>3</sup>	11,460 <sup>3</sup>
Clase AU	13,679 <sup>3</sup>	13,432 <sup>3</sup>	11,691 <sup>4</sup>
Clase AUP	11,344 <sup>3</sup>	11,337 <sup>3</sup>	10,269 <sup>7</sup>
Clase AVC	10,362 <sup>4</sup>	10,387 <sup>4</sup>	9,461 <sup>4</sup>
Clase AVH	11,804 <sup>4</sup>	11,615 <sup>4</sup>	10,165 <sup>3</sup>
Clase DEH	11,797 <sup>4</sup>	11,615 <sup>1</sup>	10,277 <sup>1</sup>
Clase IEH	12,683 <sup>4</sup>	12,470 <sup>1</sup>	10,900 <sup>1</sup>
Clase IGH	13,451 <sup>5</sup>	13,182 <sup>5</sup>	11,457 <sup>5</sup>
Clase ISH	14,035 <sup>3</sup>	13,742 <sup>3</sup>	11,915 <sup>3</sup>
Clase IU	14,331 <sup>6</sup>	14,031 <sup>0</sup>	12,133 <sup>4</sup>
Clase XU	13,566 <sup>8</sup>	13,255 <sup>4</sup>	11,399 <sup>8</sup>
Clase ZU	14,336 <sup>7</sup>	14,042 <sup>9</sup>	12,156 <sup>6</sup>
Clase ZUP	10,911 <sup>3</sup>	10,880 <sup>3</sup>	9,803 <sup>1</sup>

<sup>1</sup> La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.<sup>2</sup> La clase está denominada en SEK. La divisa base de la Cartera es el USD.<sup>3</sup> La clase está denominada en SGD. La divisa base de la Cartera es el USD.<sup>4</sup> La clase está denominada en AUD. La divisa base de la Cartera es el USD.<sup>5</sup> 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 2021

	Notas	2021 USD
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>68.819.183</b>
<b>Ingresos</b>		
Interés sobre bonos, neto	2	1.245.224
Interés bancario	2	274
<b>Total de ingresos</b>		<b>1.245.498</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(113.743)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(41)
Gastos operativos	3, 5	(59.393)
<b>Total de gastos</b>		<b>(173.177)</b>
<b>Ingresos netos de inversiones</b>		<b>1.072.321</b>
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(267.641)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(159.111)
(Pérdida) neta realizada en contratos de futuros		(15.640)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		759
<b>(Pérdida) neta realizada</b>		<b>(441.633)</b>
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		667.493
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(151.128)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de futuros		(37.203)
<b>Cambio neto en ganancia no realizada</b>		<b>479.162</b>
<b>Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>1.109.850</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		2.909.555
Reembolsos de acciones		(7.933.449)
Dividendos	7	(222.068)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>(5.245.962)</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>64.683.071</b>

### VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	64.683.071	68.819.183	47.684.339

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return

### ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 EUR
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	31.879.652
Efectivo en el banco	2	845.879
Depósitos a plazo	2, 19	893.648
Suscripciones por cobrar		12
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	7.499
Otros activos	20	574
<b>Total de activos</b>		<b>33.627.264</b>
<b>Pasivos</b>		
Reembolsos pagaderos		(156.694)
Interés bancario pagadero		(643)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	(52.564)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(15.455)
Otros pasivos	20	(5.610)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(230.966)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>33.396.298</b>

### NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	17.934,345
Clase AEP	73,265
Clase DE	32.997,477
Clase IE	629.317,427
Clase IEP	71,925
Clase LE	2.096.979,740
Clase LEP	71,870
Clase ZE	71,748
Clase ZEP	72,538

### ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AE	11,7000	11,3495	9,1419
Clase AEP	11,5954	11,2520	9,0786
Clase DE	11,4023	11,1024	9,0100
Clase IE	11,9847	11,5850	9,2667
Clase IEP	11,8827	11,4878	9,2021
Clase LE	12,0477	11,6371	9,2945
Clase LEP	11,9471	11,5394	9,2290
Clase ZE	11,9064	11,5196	9,2308
Clase ZEP	11,8117	11,4285	9,1673

### ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 EUR
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>31.879.013</b>
<b>Ingresos</b>		
Interés sobre bonos, neto	2	1.740
Interés bancario	2	2
Ingresos por intereses en contratos de futuros		149
<b>Total de ingresos</b>		<b>1.891</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(92.090)
Interés bancario	2	(12.972)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(2.047)
Gastos operativos	3, 5	(33.380)
<b>Total de gastos</b>		<b>(140.489)</b>
<b>(Pérdida) neta de inversiones</b>		<b>(138.598)</b>
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		190.887
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(113.052)
Ganancia neta realizada en contratos de futuros		255.410
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(27.720)
<b>Ganancia neta realizada</b>		<b>305.525</b>
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		926.692
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		140.538
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de futuros		(106.680)
<b>Cambio neto en ganancia no realizada</b>		<b>960.550</b>
<b>Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>1.127.477</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		998.148
Reembolsos de acciones		(608.339)
Dividendos	7	(1)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>389.808</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>33.396.298</b>

### VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
EUR	33.396.298	31.879.013	26.502.999

## Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return

## ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 USD
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	45.635.915
Efectivo en el banco	2	1.893.413
Depósitos a plazo	2, 19	3.500.010
Por cobrar para la venta de inversiones		1.186.357
Suscripciones por cobrar		83.462
Interés por cobrar en swaps	2	14.958
Interés y dividendos por cobrar, neto		30.489
Ganancia neta no realizada en swaps	2, 10	572.218
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	641.992
Otros activos	20	12.304
<b>Total de activos</b>		<b>53.571.118</b>
<b>Pasivos</b>		
Descubiertos bancarios		(48.550)
Pagadero por inversiones adquiridas		(408.361)
Reembolsos pagaderos		(25.776)
Interés pagadero en swaps	2	(7.563)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(346.990)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(59.906)
Otros pasivos	20	(12.511)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(909.657)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>52.661.461</b>

## NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	63.743,884
Clase AEH	321.629,731
Clase AKH	74,000
Clase AU	348.486,714
Clase AUP	355.872,029
Clase DEH	106.760,238
Clase DU	222.307,937
Clase IEH	73,000
Clase IGH	12.133,135
Clase IU	269.891,456
Clase W	16.463,834

## ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AEC	14,1755 <sup>1</sup>	14,0361 <sup>1</sup>	11,8961 <sup>1</sup>
Clase AEH	29,1867 <sup>1</sup>	28,7145 <sup>1</sup>	23,9870 <sup>1</sup>
Clase AKH	114,0985 <sup>2</sup>	112,0590 <sup>2</sup>	93,4570 <sup>2</sup>
Clase AU	44,0321	43,1173	35,5588
Clase AUP	16,4884	16,2512	13,5959
Clase DEH	21,0045 <sup>1</sup>	20,7320 <sup>1</sup>	17,4306 <sup>1</sup>
Clase DU	28,7655	28,2598	23,4573
Clase IEH	11,4683 <sup>1</sup>	11,2478 <sup>1</sup>	9,3386 <sup>1</sup>
Clase IGH	30,0175 <sup>3</sup>	29,3439 <sup>3</sup>	24,2056 <sup>3</sup>
Clase IU	32,7635	31,9704	26,1826
Clase W	72,4715	71,0014	58,6132

<sup>1</sup> La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.<sup>2</sup> La clase está denominada en SEK. La divisa base de la Cartera es el USD.<sup>3</sup> 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 2021

	Notas	2021 USD
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>58.030.727</b>
<b>Ingresos</b>		
Dividendos, neto	2	174.583
Interés sobre bonos, neto	2	4.190
Interés bancario	2	240
Ingresos por intereses en swaps		129.786
Ingresos por intereses en contratos de futuros		126
<b>Total de ingresos</b>		<b>308.925</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(376.595)
Interés bancario	2	(4.803)
Gastos por intereses en swaps		(4.571)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(5.139)
Gastos operativos	3, 5	(79.012)
<b>Total de gastos</b>		<b>(470.120)</b>
<b>(Pérdida) neta de inversiones</b>		<b>(161.195)</b>
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		5.784.111
Ganancia neta realizada en swaps		8.648
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(561.243)
(Pérdida) neta realizada en contratos de futuros		(2.258.630)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		23.448
<b>Ganancia neta realizada</b>		<b>2.996.334</b>
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(2.496.254)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en swaps		(20.817)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		123.758
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		549.150
<b>Cambio neto en (pérdida) no realizada</b>		<b>(1.844.163)</b>
<b>Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>990.976</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		2.542.646
Reembolsos de acciones		(8.855.951)
Dividendos	7	(46.937)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>(6.360.242)</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>52.661.461</b>

## VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	52.661.461	58.030.727	49.565.024

## Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

### ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 USD
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	151.805.834
Efectivo en el banco	2	9.390.847
Por cobrar para la venta de inversiones		1.892.143
Suscripciones por cobrar		158.157
Interés por cobrar en swaps	2	2.325
Interés y dividendos por cobrar, neto		821.632
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	72.420
Otros activos	20	34.327
<b>Total de activos</b>		<b>164.177.685</b>
<b>Pasivos</b>		
Descubiertos bancarios		(262.340)
Opciones vendidas al valor de mercado	2, 12	(61.362)
Pagadero por inversiones adquiridas		(1.052.945)
Reembolsos pagaderos		(502.572)
Interés pagadero en swaps	2	(3.630)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(1.303.239)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(103.929)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(208.132)
Otros pasivos	20	(42.781)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(3.540.930)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>160.636.755</b>

### NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	75.102,989
Clase AEC	5.199.627,748
Clase AEH	781.029,589
Clase AEP	1.632.417,183
Clase AS	100,000
Clase ASC	28.145,394
Clase ASH	639,122
Clase ASP	5.833,077
Clase AU	480.941,008
Clase AUM	40.754,701
Clase AUP	1.099.775,856
Clase DEC	2.931.144,505
Clase DEH	263.162,741
Clase DEP	340.200,826
Clase DU	400.705,147
Clase DUP	2.078.782,820
Clase ZE	73,000
Clase ZEC	93,000
Clase ZEH	18.738,800
Clase ZFH	85,000
Clase ZU	3.036,403
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 2021

	Notas	2021 USD
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>175.207.757</b>
<b>Ingresos</b>		
Dividendos, neto	2	1.316.148
Interés sobre bonos, neto	2	1.134.078
Interés bancario	2	681
Ingresos por intereses en swaps		8.334
Ingresos por intereses en contratos de futuros		1.251
<b>Total de ingresos</b>		<b>2.460.492</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.306.045)
Interés bancario	2	(3.810)
Gastos por intereses en swaps		(33.840)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(11.882)
Gastos operativos	3, 5	(259.675)
<b>Total de gastos</b>		<b>(1.615.252)</b>
<b>Ingresos netos de inversiones</b>		<b>845.240</b>
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		4.642.024
(Pérdida) neta realizada en swaps		(16.609)
(Pérdida) neta realizada en opciones		(870.068)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(51.940)
(Pérdida) neta realizada en contratos de futuros		(119.269)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(19.063)
<b>Ganancia neta realizada</b>		<b>3.565.075</b>
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(3.493.090)
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		17.188
Cambio en la ganancia neta no realizada en opciones		335.991
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(549.321)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		42.311
<b>Cambio neto en (pérdida) no realizada</b>		<b>(3.646.921)</b>
<b>Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>763.394</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		7.021.805
Reembolsos de acciones		(19.049.092)
Dividendos	7	(3.307.109)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>(15.334.396)</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>160.636.755</b>

### VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	160.636.755	175.207.757	191.964.823



## Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

### ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AE	11,4845 <sup>1</sup>	11,1664 <sup>1</sup>	9,2855 <sup>1</sup>
Clase AEC	8,0494 <sup>1</sup>	8,1761 <sup>1</sup>	6,7662 <sup>1</sup>
Clase AEH	18,1909 <sup>1</sup>	18,0258 <sup>1</sup>	14,1869 <sup>1</sup>
Clase AEP	9,3266 <sup>1</sup>	9,2989 <sup>1</sup>	8,1331 <sup>1</sup>
Clase AQ	—	—	81,0335 <sup>2</sup>
Clase AQM	—	—	80,0166 <sup>2</sup>
Clase AS	11,3544 <sup>3</sup>	11,0946 <sup>3</sup>	9,1444 <sup>3</sup>
Clase ASC	9,4299 <sup>3</sup>	9,5406 <sup>3</sup>	7,8280 <sup>3</sup>
Clase ASH	11,2058 <sup>3</sup>	11,0586 <sup>3</sup>	8,6294 <sup>3</sup>
Clase ASP	9,4589 <sup>3</sup>	9,4660 <sup>3</sup>	8,1919 <sup>3</sup>
Clase AU	20,7328	20,4434	15,8709
Clase AUM	10,0539	10,1632	8,2835
Clase AUP	9,4986	9,6048	7,8434
Clase DEC	7,6345 <sup>1</sup>	7,7834 <sup>1</sup>	6,4921 <sup>1</sup>
Clase DEH	10,3956 <sup>1</sup>	10,3401 <sup>1</sup>	8,1990 <sup>1</sup>
Clase DEP	8,7722 <sup>1</sup>	8,7797 <sup>1</sup>	7,7380 <sup>1</sup>
Clase DU	12,7902	12,6591	9,9014
Clase DUP	8,6501	8,7793	7,2225
Clase ZE	11,7478 <sup>1</sup>	11,3949 <sup>1</sup>	9,4286 <sup>1</sup>
Clase ZEC	8,8989 <sup>1</sup>	9,0180 <sup>1</sup>	7,4323 <sup>1</sup>
Clase ZEH	10,9734 <sup>1</sup>	10,8464 <sup>1</sup>	8,4917 <sup>1</sup>
Clase ZFH	10,8340 <sup>4</sup>	10,7251 <sup>4</sup>	8,4161 <sup>4</sup>
Clase ZU	12,1171	11,9183	9,2068
Clase ZUP	9,5420	9,6307	7,8321

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

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

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

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

## Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities

### ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 USD
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	8.471.445
Efectivo en el banco	2	50.658
Por cobrar para la venta de inversiones		367
Interés y dividendos por cobrar, neto		7.413
<b>Total de activos</b>		<b>8.529.883</b>
<b>Pasivos</b>		
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(2.673)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(5.024)
Otros pasivos	20	(74.075)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(81.772)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>8.448.111</b>

### NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	100,000
Clase AEC	100,000
Clase AEH	8.816,931
Clase AU	100,000
Clase AUP	100,000
Clase IE	100,000
Clase IEH	100,000
Clase IG	100,000
Clase IU	100,000
Clase LE	141.466,000
Clase LG	100,000
Clase XU	100,000
Clase ZE	100,000
Clase ZEC	100,000
Clase ZEH	100,000
Clase ZU	498.187,100
Clase ZUP	100,000

### ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021
Clase AE	12,5012 <sup>1</sup>	13,1238 <sup>1</sup>
Clase AEC	12,1465 <sup>1</sup>	13,0744 <sup>1</sup>
Clase AEH	12,2466 <sup>1</sup>	13,1208 <sup>1</sup>
Clase AU	12,4084	13,2113
Clase AUP	12,3065	13,1684
Clase IE	12,6153 <sup>1</sup>	13,1851 <sup>1</sup>
Clase IEH	12,3616 <sup>1</sup>	13,1794 <sup>1</sup>
Clase IG	11,8590 <sup>2</sup>	12,2808 <sup>2</sup>
Clase IU	12,5290	13,2780
Clase LE	12,6611 <sup>1</sup>	13,2092 <sup>1</sup>
Clase LG	11,8904 <sup>2</sup>	12,2989 <sup>2</sup>
Clase XU	12,6093	13,3214
Clase ZE	12,5967 <sup>1</sup>	13,1739 <sup>1</sup>
Clase ZEC	12,2419 <sup>1</sup>	13,1241 <sup>1</sup>
Clase ZEH	12,3422 <sup>1</sup>	13,1675 <sup>1</sup>
Clase ZU	12,5007	13,2623
Clase ZUP	12,3979	13,2192

<sup>1</sup> La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.<sup>2</sup> 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 2021

	Notas	2021 USD
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>9.412.889</b>
<b>Ingresos</b>		
Dividendos, neto	2	40.550
Interés bancario	2	12
<b>Total de ingresos</b>		<b>40.562</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(31.775)
Gastos operativos	3, 5	(12.652)
<b>Total de gastos</b>		<b>(44.427)</b>
<b>(Pérdida) neta de inversiones</b>		<b>(3.865)</b>
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(126.031)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(2.187)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(4.869)
<b>(Pérdida) neta realizada</b>		<b>(133.087)</b>
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(399.143)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(728)
<b>Cambio neto en (pérdida) no realizada</b>		<b>(399.871)</b>
<b>(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>(536.823)</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		584.359
Reembolsos de acciones		(1.012.286)
Dividendos	7	(28)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>(427.955)</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>8.448.111</b>

### VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021
USD	8.448.111	9.412.889

## Threadneedle (Lux) - Global Focus

## ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 USD
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	2.166.801.576
Efectivo en el banco	2	6.359.573
Por cobrar para la venta de inversiones		662.322
Suscripciones por cobrar		7.461.777
Interés y dividendos por cobrar, neto		837.764
Otros activos	20	362.639
<b>Total de activos</b>		<b>2.182.485.651</b>
<b>Pasivos</b>		
Descubiertos bancarios		(234.841)
Reembolsos pagaderos		(8.113.903)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(3.802.186)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(1.995.983)
Otros pasivos	20	(478.701)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(14.625.614)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>2.167.860.037</b>

## NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	1.467.031,645
Clase AEP	2.242.811,963
Clase AU	7.474.127,635
Clase AUP	34.807,762
Clase DEH	341.367,199
Clase DU	1.285.171,337
Clase IE	8.300.976,449
Clase IEH	2.876.335,622
Clase IU	14.970.860,293
Clase IUP	50.192,554
Clase W	18.021,468
Clase XU	8.686.295,823
Clase ZE	2.692.812,297
Clase ZEH	4.358,000
Clase ZEP	2.624.907,446
Clase ZFH	106.165,000
Clase ZG	664.410,816
Clase ZU	4.257.578,080

## ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 USD
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>1.676.310.766</b>
<b>Ingresos</b>		
Dividendos, neto	2	6.064.627
Interés bancario	2	780
<b>Total de ingresos</b>		<b>6.065.407</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(10.647.797)
Interés bancario	2	(2.337)
Gastos operativos	3, 5	(2.558.175)
<b>Total de gastos</b>		<b>(13.208.309)</b>
<b>(Pérdida) neta de inversiones</b>		<b>(7.142.902)</b>
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		65.087.269
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(2.296.059)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(44.695)
<b>Ganancia neta realizada</b>		<b>62.746.515</b>
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		147.730.846
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(1.607.642)
<b>Cambio neto en ganancia no realizada</b>		<b>146.123.204</b>
<b>Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>201.726.817</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		473.809.468
Reembolsos de acciones		(183.517.880)
Dividendos	7	(469.134)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>289.822.454</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>2.167.860.037</b>

## VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	2.167.860.037	1.676.310.766	781.859.426

## Threadneedle (Lux) - Global Focus

### ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AEH	64,1729 <sup>1</sup>	57,4173 <sup>1</sup>	39,4473 <sup>1</sup>
Clase AEP	21,6812 <sup>1</sup>	19,1012 <sup>1</sup>	13,9549 <sup>1</sup>
Clase AU	108,4428	96,5311	65,4043
Clase AUP	17,2685	15,4283	10,5256
Clase DEH	46,1550 <sup>1</sup>	41,4515 <sup>1</sup>	28,6905 <sup>1</sup>
Clase DU	56,1580	50,1776	34,2524
Clase IE	20,9598 <sup>1</sup>	18,3198 <sup>1</sup>	13,1834 <sup>1</sup>
Clase IEH	17,3538 <sup>1</sup>	15,4630 <sup>1</sup>	10,5330 <sup>1</sup>
Clase IU	22,2397	19,7127	13,2437
Clase IUP	17,7511	15,7922	10,6770
Clase W	165,6981	147,4604	99,8614
Clase XU	25,9388	22,8996	15,2627
Clase ZE	23,6224 <sup>1</sup>	20,6574 <sup>1</sup>	14,8804 <sup>1</sup>
Clase ZEH	12,4880 <sup>1</sup>	11,1310 <sup>1</sup>	–
Clase ZEP	22,4025 <sup>1</sup>	19,6580 <sup>1</sup>	14,2420 <sup>1</sup>
Clase ZFH	12,4475 <sup>2</sup>	11,1109 <sup>2</sup>	–
Clase ZG	23,7167 <sup>3</sup>	20,5546 <sup>3</sup>	15,3810 <sup>3</sup>
Clase ZU	26,9215	23,8745	16,0557

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

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

<sup>3</sup> 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 2021

	Notas	2021 USD
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	171.525.449
Efectivo en el banco	2	961.789
Por cobrar para la venta de inversiones		299.207
Suscripciones por cobrar		29.053
Interés y dividendos por cobrar, neto		126.502
Otros activos	20	12.341
<b>Total de activos</b>		<b>172.954.341</b>
<b>Pasivos</b>		
Reembolsos pagaderos		(2.386)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(68.688)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(135.968)
Impuestos a pagar	3	(840.618)
Otros pasivos	20	(1.477.951)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(2.525.611)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>170.428.730</b>

## NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	20.998,437
Clase AU	27.029,678
Clase DEH	49.505,455
Clase DU	67.630,705
Clase IE	7.882,588
Clase IEH	26.205,875
Clase IU	6.453.328,168
Clase ZU	18.803,392
Clase 1E	3.260.835,179
Clase 1U	2.877.479,854
Clase 2E	2.016.097,894
Clase 2U	53,000
Clase 8E	2.221.457,961
Clase 8U	1.631.091,613

## ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AEH	40,2528 <sup>1</sup>	42,3802 <sup>1</sup>	23,6114 <sup>1</sup>
Clase AU	65,3403	68,3931	37,5590
Clase DEH	28,5800 <sup>1</sup>	30,1969 <sup>1</sup>	16,9558 <sup>1</sup>
Clase DU	45,5484	47,8562	26,4784
Clase IE	15,1015 <sup>1</sup>	15,5210 <sup>1</sup>	-
Clase IEH	24,3309 <sup>1</sup>	25,5028 <sup>1</sup>	14,0970 <sup>1</sup>
Clase IU	15,6289	16,2895	8,8704
Clase ZU	14,9562	15,5962	8,5014
Clase 1E	1,8239 <sup>1</sup>	1,8817 <sup>1</sup>	1,1059 <sup>1</sup>
Clase 1U	2,1135	2,2113	1,2133
Clase 2E	16,7116 <sup>1</sup>	17,1886 <sup>1</sup>	10,0408 <sup>1</sup>
Clase 2U	17,0894	17,8242	9,7175
Clase 8E	1,9985 <sup>1</sup>	2,0559 <sup>1</sup>	1,2015 <sup>1</sup>
Clase 8U	2,3163	2,4165	1,3184

<sup>1</sup> 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 2021

	Notas	2021 USD
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>170.104.097</b>
<b>Ingresos</b>		
Dividendos, neto	2	912.380
Interés bancario	2	444
<b>Total de ingresos</b>		<b>912.824</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(838.128)
Interés bancario	2	(1)
Impuestos extranjeros	3	(304.618)
Gastos operativos	3, 5	(161.194)
<b>Total de gastos</b>		<b>(1.303.941)</b>
<b>(Pérdida) neta de inversiones</b>		<b>(391.117)</b>
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(2.949.030)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(68.783)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(5.028)
<b>(Pérdida) neta realizada</b>		<b>(3.022.841)</b>
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(4.492.796)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(13.738)
<b>Cambio neto en (pérdida) no realizada</b>		<b>(4.506.534)</b>
<b>(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>(7.920.492)</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		21.901.436
Reembolsos de acciones		(13.656.311)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>8.245.125</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>170.428.730</b>

## VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	170.428.730	170.104.097	79.154.413

## Threadneedle (Lux) - Global Equity Income

### ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 USD
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	210.874.497
Efectivo en el banco	2	3.653.017
Por cobrar para la venta de inversiones		973.079
Suscripciones por cobrar		199.611
Interés y dividendos por cobrar, neto		355.194
Otros activos	20	62.063
<b>Total de activos</b>		<b>216.117.461</b>
<b>Pasivos</b>		
Descubiertos bancarios		(593.713)
Reembolsos pagaderos		(430.271)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(54.838)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(180.361)
Otros pasivos	20	(34.552)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(1.293.735)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>214.823.726</b>

### NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	4.826,000
Clase AUP	84,000
Clase DEC	77,000
Clase DUP	85,000
Clase IU	75,000
Clase TE	66,000
Clase ZU	75,000
Clase 1E	1.794.348,872
Clase 1EP	1.505.155,158
Clase 1SC	450.609,161
Clase 1SH	46.059,454
Clase 1ST	54.807,834
Clase 1U	453.353,678
Clase 1UP	419.116,165
Clase 1VT	7.508,505
Clase 2E	865.429,970
Clase 2EP	72,000
Clase 2U	75,000
Clase 2UP	82,000
Clase 3E	173.121,447
Clase 3EP	9.943.720,859
Clase 3U	17.230,767
Clase 3UP	39.417,584
Clase 8E	121.759,155
Clase 8EP	237,977
Clase 8U	13.233,578
Clase 8UP	57.981,704
Clase 9E	65,000
Clase 9EP	72,000
Clase 9U	74,000
Clase 9UP	82,000

### ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 USD
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>220.612.038</b>
<b>Ingresos</b>		
Dividendos, neto	2	3.118.039
Interés bancario	2	158
<b>Total de ingresos</b>		<b>3.118.197</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.126.224)
Interés bancario	2	(135)
Gastos operativos	3, 5	(196.129)
<b>Total de gastos</b>		<b>(1.322.488)</b>
<b>Ingresos netos de inversiones</b>		<b>1.795.709</b>
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		14.372.245
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		2.759
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		5.692
<b>Ganancia neta realizada</b>		<b>14.380.696</b>
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(12.765.933)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(62.945)
<b>Cambio neto en (pérdida) no realizada</b>		<b>(12.828.878)</b>
<b>Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>3.347.527</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		10.130.186
Reembolsos de acciones		(16.604.476)
Dividendos	7	(2.661.549)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>(9.135.839)</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>214.823.726</b>

### VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	214.823.726	220.612.038	302.458.662

## Threadneedle (Lux) - Global Equity Income

### ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AEC	10,7528 <sup>1</sup>	10,8646 <sup>1</sup>	7,7949 <sup>1</sup>
Clase AUP	11,4648	11,5197	8,1529
Clase DEC	10,5980 <sup>1</sup>	10,7367 <sup>1</sup>	7,7468 <sup>1</sup>
Clase DUP	11,2878	11,3689	8,0829
Clase IU	13,0109	12,8194	8,7152
Clase TE	12,8235 <sup>1</sup>	12,4675 <sup>1</sup>	9,0928 <sup>1</sup>
Clase ZU	12,9935	12,8038	8,7095
Clase 1E	12,6202 <sup>1</sup>	12,3011 <sup>1</sup>	9,0161 <sup>1</sup>
Clase 1EP	11,4014 <sup>1</sup>	11,2887 <sup>1</sup>	8,5463 <sup>1</sup>
Clase 1SC	11,2275 <sup>2</sup>	11,2960 <sup>2</sup>	8,0406 <sup>2</sup>
Clase 1SH	12,4470 <sup>2</sup>	12,3246 <sup>2</sup>	8,4957 <sup>2</sup>
Clase 1ST	11,2477 <sup>2</sup>	11,3150 <sup>2</sup>	8,0568 <sup>2</sup>
Clase 1U	12,7664	12,6191	8,6349
Clase 1UP	11,5138	11,5601	8,1749
Clase 1VT	10,9431 <sup>3</sup>	11,0336 <sup>3</sup>	7,9347 <sup>3</sup>
Clase 2E	13,0847 <sup>1</sup>	12,7149 <sup>1</sup>	9,2630 <sup>1</sup>
Clase 2EP	11,6220 <sup>1</sup>	11,4725 <sup>1</sup>	8,6258 <sup>1</sup>
Clase 2U	12,9951	12,8080	8,7103
Clase 2UP	11,7601	11,7699	8,2624
Clase 3E	12,9011 <sup>1</sup>	12,5276 <sup>1</sup>	9,1138 <sup>1</sup>
Clase 3EP	11,6515 <sup>1</sup>	11,4904 <sup>1</sup>	8,6418 <sup>1</sup>
Clase 3U	13,0504	12,8514	8,7285
Clase 3UP	11,8013	11,8020	8,2797
Clase 8E	12,8277 <sup>1</sup>	12,4677 <sup>1</sup>	9,0865 <sup>1</sup>
Clase 8EP	11,5665 <sup>1</sup>	11,4170 <sup>1</sup>	8,5947 <sup>1</sup>
Clase 8U	12,9798	12,7934	8,7047
Clase 8UP	11,7244	11,7367	8,2462
Clase 9E	12,9309 <sup>1</sup>	12,5555 <sup>1</sup>	9,1275 <sup>1</sup>
Clase 9EP	11,6789 <sup>1</sup>	11,5171 <sup>1</sup>	8,6420 <sup>1</sup>
Clase 9U	13,0927	12,8935	8,7456
Clase 9UP	11,8128	11,8108	8,2711

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

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

<sup>3</sup> 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 2021

	Notas	2021 USD
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	617.685.226
Efectivo en el banco	2	2.349.941
Por cobrar para la venta de inversiones		7.860.268
Suscripciones por cobrar		7.999.571
Interés y dividendos por cobrar, neto		518.667
Otros activos	20	127.428
<b>Total de activos</b>		<b>636.541.101</b>
<b>Pasivos</b>		
Pagadero por inversiones adquiridas		(8.202.727)
Reembolsos pagaderos		(54.847)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(726.712)
Otros pasivos	20	(92.173)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(9.076.459)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>627.464.642</b>

### NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase IU	41.592,985
Clase ZU	60,000
Clase 1E	23.034.591,166
Clase 1U	78.676.553,394
Clase 2E	53,000
Clase 2U	246.030,349
Clase 3U	5.126.114,335
Clase 8E	84.211,592
Clase 8U	20.423.346,173
Clase 9U	100.054,654

### ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase IU	16,4127	15,4100	10,4063
Clase ZU	16,3830	15,3846	10,3985
Clase 1E	3,9069 <sup>1</sup>	3,6305 <sup>1</sup>	2,6451 <sup>1</sup>
Clase 1U	4,5273	4,2662	2,9019
Clase 2E	16,1104 <sup>1</sup>	14,9212 <sup>1</sup>	10,8024 <sup>1</sup>
Clase 2U	16,3695	15,3787	10,3974
Clase 3U	4,8126	4,5175	3,0491
Clase 8E	5,7210 <sup>1</sup>	5,3010 <sup>1</sup>	3,8404 <sup>1</sup>
Clase 8U	6,6292	6,2292	4,2132
Clase 9U	16,4602	15,4477	10,4222

<sup>1</sup> 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 2021

	Notas	2021 USD
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>605.915.496</b>
<b>Ingresos</b>		
Dividendos, neto	2	2.782.943
Interés bancario	2	219
<b>Total de ingresos</b>		<b>2.783.162</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(4.328.600)
Interés bancario	2	(210)
Gastos operativos	3, 5	(517.570)
<b>Total de gastos</b>		<b>(4.846.380)</b>
<b>(Pérdida) neta de inversiones</b>		<b>(2.063.218)</b>
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		35.606.355
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(900)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(31.890)
<b>Ganancia neta realizada</b>		<b>35.573.565</b>
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		2.789.561
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		230
<b>Cambio neto en ganancia no realizada</b>		<b>2.789.791</b>
<b>Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>36.300.138</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		45.971.433
Reembolsos de acciones		(60.722.425)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>(14.750.992)</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>627.464.642</b>

### VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	627.464.642	605.915.496	365.150.642



## Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies

### ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 EUR
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	2.002.066.670
Efectivo en el banco	2	3.085.725
Por cobrar para la venta de inversiones		24.851.678
Suscripciones por cobrar		10.998.790
Interés y dividendos por cobrar, neto		1.018.907
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	106.920
Otros activos	20	175.009
<b>Total de activos</b>		<b>2.042.303.699</b>
<b>Pasivos</b>		
Pagadero por inversiones adquiridas		(16.544.440)
Reembolsos pagaderos		(4.519.453)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(1.848.777)
Otros pasivos	20	(435.272)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(23.347.942)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>2.018.955.757</b>

### NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	13.358.987,855
Clase AEP	13.649.547,679
Clase AK	1.159.634,561
Clase AUP	58.540,158
Clase DE	1.450.156,989
Clase IE	7.407.375,150
Clase IEP	3.446.825,793
Clase NE	4.765.413,000
Clase XE	1.493.334,540
Clase XFH	78,000
Clase XG	41,000
Clase XGH	30,000
Clase XU	5.717.517,656
Clase ZE	3.114.726,279
Clase ZFH	1.117.865,023
Clase ZG	1.046.940,269
Clase ZGH	60.582,002
Clase ZU	6.693.333,350

### ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 EUR
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>2.108.588.124</b>
<b>Ingresos</b>		
Dividendos, neto	2	6.859.507
Interés bancario	2	260
<b>Total de ingresos</b>		<b>6.859.767</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(10.341.880)
Interés bancario	2	(4.764)
Gastos operativos	3, 5	(2.496.250)
<b>Total de gastos</b>		<b>(12.842.894)</b>
<b>(Pérdida) neta de inversiones</b>		<b>(5.983.127)</b>
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		191.894.089
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		160.816
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		160.640
<b>Ganancia neta realizada</b>		<b>192.215.545</b>
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		24.415.890
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		74.159
<b>Cambio neto en ganancia no realizada</b>		<b>24.490.049</b>
<b>Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>210.722.467</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		490.673.559
Reembolsos de acciones		(791.028.393)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>(300.354.834)</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>2.018.955.757</b>

### VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
EUR	2.018.955.757	2.108.588.124	467.243.010

## Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies

### ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AE	52,7422	47,2890	28,8263
Clase AEP	17,3820	15,5848	9,5558
Clase AK	140,0052 <sup>1</sup>	126,8311 <sup>1</sup>	82,0449 <sup>1</sup>
Clase AUP	17,1036 <sup>2</sup>	15,5516 <sup>2</sup>	8,9026 <sup>2</sup>
Clase DE	40,1195	36,0617	22,0920
Clase IE	76,7155	68,4913	41,3989
Clase IEP	14,6849	13,1106	–
Clase NE	16,8430	15,0223	9,0621
Clase XE	19,4742	17,3169	10,3840
Clase XFH	12,8457 <sup>3</sup>	11,4338 <sup>3</sup>	–
Clase XG	19,0420 <sup>4</sup>	16,7790 <sup>4</sup>	10,4565 <sup>4</sup>
Clase XGH	26,3977 <sup>4</sup>	23,4350 <sup>4</sup>	14,0424 <sup>4</sup>
Clase XU	12,6194 <sup>2</sup>	11,3797 <sup>2</sup>	–
Clase ZE	18,8796	16,8641	10,2035
Clase ZFH	18,6033 <sup>3</sup>	16,6452 <sup>3</sup>	10,1002 <sup>3</sup>
Clase ZG	18,4938 <sup>4</sup>	16,3719 <sup>4</sup>	10,2901 <sup>4</sup>
Clase ZGH	54,8463 <sup>4</sup>	48,9276 <sup>4</sup>	29,5931 <sup>4</sup>
Clase ZU	18,5527 <sup>2</sup>	16,8058 <sup>2</sup>	9,4930 <sup>2</sup>

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

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

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

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

## Threadneedle (Lux) - American

## ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 USD
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	1.167.746.060
Efectivo en el banco	2	5.718.514
Por cobrar para la venta de inversiones		1.079.382
Suscripciones por cobrar		2.227.183
Interés y dividendos por cobrar, neto		686.965
Otros activos	20	901
<b>Total de activos</b>		<b>1.177.459.005</b>
<b>Pasivos</b>		
Pagadero por inversiones adquiridas		(1.506.281)
Reembolsos pagaderos		(971.944)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(3.226.033)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(1.041.891)
Otros pasivos	20	(187.684)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(6.933.833)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>1.170.525.172</b>

## NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	1.266.703,898
Clase AU	281.975,803
Clase DEH	51.693,040
Clase DU	496.523,035
Clase IEH	381.987,169
Clase IU	6.395.507,102
Clase W	1.598,035
Clase ZE	52,000
Clase ZEH	1.359.989,874
Clase ZU	60,000
Clase 1E	2.818.310,991
Clase 1EH	188.854,698
Clase 1EP	305.569,845
Clase 1U	13.027.242,863
Clase 2E	782.050,179
Clase 2U	5.463.289,441
Clase 3EH	45.378,315
Clase 3U	189.585,524
Clase 8E	1.820.481,492
Clase 8U	2.725.811,324
Clase 9EH	55,000
Clase 9U	263.923,350

## ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 USD
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>1.120.251.631</b>
<b>Ingresos</b>		
Dividendos, neto	2	4.746.947
Interés bancario	2	574
<b>Total de ingresos</b>		<b>4.747.521</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(6.192.210)
Interés bancario	2	(85)
Gastos operativos	3, 5	(1.112.433)
<b>Total de gastos</b>		<b>(7.304.728)</b>
<b>(Pérdida) neta de inversiones</b>		<b>(2.557.207)</b>
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		157.345.279
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(1.959.193)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		25.026
<b>Ganancia neta realizada</b>		<b>155.411.112</b>
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(77.416.501)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(1.094.124)
<b>Cambio neto en (pérdida) no realizada</b>		<b>(78.510.625)</b>
<b>Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>74.343.280</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		111.847.348
Reembolsos de acciones		(135.917.087)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>(24.069.739)</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>1.170.525.172</b>

## VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	1.170.525.172	1.120.251.631	845.435.297

## Threadneedle (Lux) - American

### ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AEH	66,3172 <sup>1</sup>	62,4805 <sup>1</sup>	39,8500 <sup>1</sup>
Clase AU	114,9440	107,7058	67,7834
Clase DEH	48,9894 <sup>1</sup>	46,2355 <sup>1</sup>	29,5927 <sup>1</sup>
Clase DU	44,6334	41,8962	26,4589
Clase IEH	71,8317 <sup>1</sup>	67,3710 <sup>1</sup>	42,5805 <sup>1</sup>
Clase IU	78,7849	73,4915	45,8385
Clase W	153,1627	143,3024	89,9169
Clase ZE	16,4814 <sup>1</sup>	15,1672 <sup>1</sup>	10,1443 <sup>1</sup>
Clase ZEH	15,2786 <sup>1</sup>	14,3367 <sup>1</sup>	9,0706 <sup>1</sup>
Clase ZU	16,5068	15,4031	9,6205
Clase 1E	15,8331 <sup>1</sup>	14,6201 <sup>1</sup>	9,8427 <sup>1</sup>
Clase 1EH	14,8953 <sup>1</sup>	14,0242 <sup>1</sup>	8,9324 <sup>1</sup>
Clase 1EP	15,2107 <sup>1</sup>	14,0455 <sup>1</sup>	9,5797 <sup>1</sup>
Clase 1U	15,8475	14,8399	9,3272
Clase 2E	16,1260 <sup>1</sup>	14,8451 <sup>1</sup>	9,9337 <sup>1</sup>
Clase 2U	16,1381	15,0659	9,4120
Clase 3EH	15,2451 <sup>1</sup>	14,2960 <sup>1</sup>	9,0365 <sup>1</sup>
Clase 3U	16,2243	15,1327	9,4368
Clase 8E	16,1052 <sup>1</sup>	14,8290 <sup>1</sup>	9,9269 <sup>1</sup>
Clase 8U	16,1142	15,0466	9,4037
Clase 9EH	15,2753 <sup>1</sup>	14,3200 <sup>1</sup>	9,0418 <sup>1</sup>
Clase 9U	16,2368	15,1413	9,4383

<sup>1</sup> 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 2021

	Notas	2021 USD
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	443.170.114
Efectivo en el banco	2	798.782
Depósitos a plazo	2, 19	9.500.024
Suscripciones por cobrar		226.888
Interés y dividendos por cobrar, neto		128.773
Otros activos	20	161
<b>Total de activos</b>		<b>453.824.742</b>
<b>Pasivos</b>		
Pagadero por inversiones adquiridas		(814.545)
Reembolsos pagaderos		(74.729)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(56.537)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(550.162)
Otros pasivos	20	(64.154)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(1.560.127)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>452.264.615</b>

### NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AD	405,000
Clase AEH	17.456,927
Clase AN	524,000
Clase AU	122.907,142
Clase DEH	16.236,739
Clase DU	111.019,627
Clase ID	399,000
Clase IE	54,000
Clase IEH	14.933,561
Clase IN	517,000
Clase W	9.833,367
Clase ZEH	53,000
Clase ZU	5.343,035
Clase 1E	13.417.877,668
Clase 1EH	76.311,298
Clase 1EP	425.663,328
Clase 1U	41.496.793,940
Clase 2EH	712,000
Clase 2U	3.119,818
Clase 3E	2.126.261,621
Clase 3U	4.108.785,512
Clase 8EH	4.562,812
Clase 8U	2.656.532,516
Clase 9E	50,000
Clase 9U	1.084,818

### ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 USD
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>438.535.319</b>
<b>Ingresos</b>		
Dividendos, neto	2	1.325.484
Interés bancario	2	1.096
<b>Total de ingresos</b>		<b>1.326.580</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(3.321.332)
Interés bancario	2	(55)
Gastos operativos	3, 5	(390.333)
<b>Total de gastos</b>		<b>(3.711.720)</b>
<b>(Pérdida) neta de inversiones</b>		<b>(2.385.140)</b>
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		146.140.037
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(35.475)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(180.679)
<b>Ganancia neta realizada</b>		<b>145.923.883</b>
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(101.177.747)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(4.842)
<b>Cambio neto en (pérdida) no realizada</b>		<b>(101.182.589)</b>
<b>Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>42.356.154</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		22.861.733
Reembolsos de acciones		(51.488.591)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>(28.626.858)</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>452.264.615</b>

### VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	452.264.615	438.535.319	315.353.771

## Threadneedle (Lux) - American Select

### ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AD	15,5897 <sup>1</sup>	14,0643 <sup>1</sup>	9,5986 <sup>1</sup>
Clase AEH	43,9767 <sup>2</sup>	40,4315 <sup>2</sup>	26,0234 <sup>2</sup>
Clase AN	16,3889 <sup>3</sup>	14,6605 <sup>3</sup>	11,4489 <sup>3</sup>
Clase AU	40,3461	36,9044	23,4327
Clase DEH	29,9669 <sup>2</sup>	27,6535 <sup>2</sup>	17,9318 <sup>2</sup>
Clase DU	35,4398	32,5387	20,8155
Clase ID	15,8693 <sup>1</sup>	14,2588 <sup>1</sup>	9,6523 <sup>1</sup>
Clase IE	15,9368 <sup>2</sup>	14,3186 <sup>2</sup>	9,6644 <sup>2</sup>
Clase IEH	46,8488 <sup>2</sup>	42,8992 <sup>2</sup>	27,3895 <sup>2</sup>
Clase IN	16,6677 <sup>3</sup>	14,8493 <sup>3</sup>	11,5094 <sup>3</sup>
Clase W	42,6811	39,0305	24,7704
Clase ZEH	15,7836 <sup>2</sup>	14,4664 <sup>2</sup>	9,2429 <sup>2</sup>
Clase ZU	17,0375	15,5296	9,7922
Clase 1E	5,9809 <sup>2</sup>	5,3911 <sup>2</sup>	3,6619 <sup>2</sup>
Clase 1EH	4,6629 <sup>2</sup>	4,2840 <sup>2</sup>	2,7534 <sup>2</sup>
Clase 1EP	5,8298 <sup>2</sup>	5,2548 <sup>2</sup>	3,5938 <sup>2</sup>
Clase 1U	6,9314	6,3360	4,0179
Clase 2EH	16,3170 <sup>2</sup>	14,9450 <sup>2</sup>	9,5434 <sup>2</sup>
Clase 2U	17,2928	15,7585	9,9304
Clase 3E	4,8887 <sup>2</sup>	4,3890 <sup>2</sup>	2,9575 <sup>2</sup>
Clase 3U	5,6656	5,1582	3,2451
Clase 8EH	4,0974 <sup>2</sup>	3,7559 <sup>2</sup>	2,4004 <sup>2</sup>
Clase 8U	7,9911	7,2838	4,5928
Clase 9E	17,0675 <sup>2</sup>	15,3150 <sup>2</sup>	10,3117 <sup>2</sup>
Clase 9U	17,4205	15,8570	9,9683

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

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

<sup>3</sup> 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 2021

	Notas	2021 USD
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	330.681.370
Efectivo en el banco	2	3.708.735
Por cobrar para la venta de inversiones		3.028.863
Suscripciones por cobrar		662.020
Interés y dividendos por cobrar, neto		41.052
<b>Total de activos</b>		<b>338.122.040</b>
<b>Pasivos</b>		
Pagadero por inversiones adquiridas		(2.606.372)
Reembolsos pagaderos		(430.834)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(186.304)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(325.061)
Otros pasivos	20	(44.488)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(3.593.059)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>334.528.981</b>

## NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	105.312,297
Clase AU	41.403,056
Clase DEH	22.137,584
Clase DU	57.546,643
Clase IE	302.242,069
Clase IU	315.767,538
Clase ZU	8.109,446
Clase 1E	615.228,479
Clase 1EP	925.042,448
Clase 1U	7.310.103,283
Clase 2U	1.623.088,834
Clase 3EH	323.565,863
Clase 3U	1.610.106,926
Clase 8U	1.326.884,432
Clase 9EH	18.302,351
Clase 9U	3.579.849,517

## ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AEH	16,7927 <sup>1</sup>	16,6368 <sup>1</sup>	8,2252 <sup>1</sup>
Clase AU	17,8926	17,6124	8,5873
Clase DEH	16,5494 <sup>1</sup>	16,4357 <sup>1</sup>	8,1660 <sup>1</sup>
Clase DU	17,6395	17,4069	8,5270
Clase IE	16,4517 <sup>1</sup>	15,9009 <sup>1</sup>	8,2360 <sup>1</sup>
Clase IU	18,3486	17,9845	8,6950
Clase ZU	18,3109	17,9572	8,6865
Clase 1E	17,7895 <sup>1</sup>	17,2570 <sup>1</sup>	8,9994 <sup>1</sup>
Clase 1EP	17,0750 <sup>1</sup>	16,5639 <sup>1</sup>	8,7169 <sup>1</sup>
Clase 1U	17,9724	17,6803	8,6079
Clase 2U	18,2978	17,9455	8,6842
Clase 3EH	17,2385 <sup>1</sup>	17,0018 <sup>1</sup>	8,3303 <sup>1</sup>
Clase 3U	18,3688	18,0025	8,6996
Clase 8U	18,2849	17,9365	8,6833
Clase 9EH	17,2834 <sup>1</sup>	17,0449 <sup>1</sup>	8,3502 <sup>1</sup>
Clase 9U	18,3963	18,0258	8,7074

<sup>1</sup> 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 2021

	Notas	2021 USD
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>317.052.344</b>
<b>Ingresos</b>		
Dividendos, neto	2	1.376.031
Interés bancario	2	170
<b>Total de ingresos</b>		<b>1.376.201</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(2.006.046)
Interés bancario	2	(9)
Gastos operativos	3, 5	(272.610)
<b>Total de gastos</b>		<b>(2.278.665)</b>
<b>(Pérdida) neta de inversiones</b>		<b>(902.464)</b>
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		33.798.521
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(27.247)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(76.562)
<b>Ganancia neta realizada</b>		<b>33.694.712</b>
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(26.721.401)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(170.569)
<b>Cambio neto en (pérdida) no realizada</b>		<b>(26.891.970)</b>
<b>Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>5.900.278</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		68.987.801
Reembolsos de acciones		(57.411.442)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>11.576.359</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>334.528.981</b>

## VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	334.528.981	317.052.344	172.396.358

## Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity

### ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 USD
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	123.504.167
Efectivo en el banco	2	586.987
Por cobrar para la venta de inversiones		2.649.369
Interés y dividendos por cobrar, neto		129.620
Otros activos	20	17.792
<b>Total de activos</b>		<b>126.887.935</b>
<b>Pasivos</b>		
Pagadero por inversiones adquiridas		(633.336)
Reembolsos pagaderos		(673)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(6.410)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(4.708)
Impuestos a pagar	3	(370.207)
Otros pasivos	20	(2.208.886)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(3.224.220)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>123.663.715</b>

### NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	1.735,856
Clase AF	51,000
Clase AS	857,690
Clase ASH	38.805,563
Clase AU	13.470,457
Clase DE	24.901,814
Clase IF	49,000
Clase ISH	71,000
Clase IU	2.579,493
Clase XU	4.762.395,036
Clase XUP	3.851.982,556
Clase ZE	156.125,000
Clase ZEH	49,000
Clase ZF	2.949,000
Clase ZG	60,000
Clase ZU	37.384,939

### ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AE	16,1093 <sup>1</sup>	18,3066 <sup>1</sup>	11,6808 <sup>1</sup>
Clase AF	16,0523 <sup>2</sup>	18,6638 <sup>2</sup>	11,4321 <sup>2</sup>
Clase AS	12,5259 <sup>3</sup>	14,2865 <sup>3</sup>	9,0235 <sup>3</sup>
Clase ASH	15,5246 <sup>3</sup>	17,9279 <sup>3</sup>	10,7767 <sup>3</sup>
Clase AU	16,2927	18,7762	11,1870
Clase DE	15,3019 <sup>1</sup>	17,4547 <sup>1</sup>	11,2228 <sup>1</sup>
Clase IF	16,8151 <sup>2</sup>	19,4667 <sup>2</sup>	11,8248 <sup>2</sup>
Clase ISH	16,4795 <sup>3</sup>	18,9488 <sup>3</sup>	11,2943 <sup>3</sup>
Clase IU	17,2536	19,7990	11,6971
Clase XU	13,1085	14,9820	8,7810
Clase XUP	14,6152	16,9577	10,1785
Clase ZE	16,8456 <sup>1</sup>	19,0713 <sup>1</sup>	12,0806 <sup>1</sup>
Clase ZEH	15,1590 <sup>1</sup>	17,5088 <sup>1</sup>	10,5075 <sup>1</sup>
Clase ZF	16,7977 <sup>2</sup>	19,4570 <sup>2</sup>	11,8269 <sup>2</sup>
Clase ZG	10,8332 <sup>4</sup>	12,1521 <sup>4</sup>	7,9962 <sup>4</sup>
Clase ZU	17,2000	19,7473	11,6781

<sup>1</sup> La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.<sup>2</sup> La clase está denominada en CHF. La divisa base de la Cartera es el USD.<sup>3</sup> La clase está denominada en SGD. La divisa base de la Cartera es el USD.<sup>4</sup> 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 2021

	Notas	2021 USD
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>188.088.458</b>
<b>Ingresos</b>		
Dividendos, neto	2	1.854.604
Interés bancario	2	148
<b>Total de ingresos</b>		<b>1.854.752</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(32.635)
Interés bancario	2	(34)
Impuestos extranjeros	3	(2.766)
Gastos operativos	3, 5	(118.346)
<b>Total de gastos</b>		<b>(153.781)</b>
<b>Ingresos netos de inversiones</b>		<b>1.700.971</b>
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		10.336.670
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(4.002)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(63.713)
<b>Ganancia neta realizada</b>		<b>10.268.955</b>
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(29.585.189)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		1.837
<b>Cambio neto en (pérdida) no realizada</b>		<b>(29.583.352)</b>
<b>(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>(17.613.426)</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		806.374
Reembolsos de acciones		(46.731.735)
Dividendos	7	(885.956)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>(46.811.317)</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>123.663.715</b>

### VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	123.663.715	188.088.458	124.384.661

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.



## Threadneedle (Lux) - Asia Equities

## ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 USD
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	317.466.476
Efectivo en el banco	2	1.555.166
Por cobrar para la venta de inversiones		3.084.931
Suscripciones por cobrar		112.650
Interés y dividendos por cobrar, neto		236.084
Otros activos	20	34.598
<b>Total de activos</b>		<b>322.489.905</b>
<b>Pasivos</b>		
Pagadero por inversiones adquiridas		(623.222)
Reembolsos pagaderos		(212.705)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(35)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(305.393)
Impuestos a pagar	3	(1.342.691)
Otros pasivos	20	(5.105.176)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(7.589.222)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>314.900.683</b>

## NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	83,000
Clase AEH	83,000
Clase DE	83,000
Clase DEH	83,000
Clase IE	561.751,633
Clase IU	326.195,923
Clase ZU	62,000
Clase 1E	1.509.881,069
Clase 1U	23.582.001,887
Clase 2E	9.204.571,512
Clase 2U	1.645.891,242
Clase 3U	5.875.309,887
Clase 8E	676,483
Clase 8U	1.539.249,366
Clase 9U	8.464,188

## ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AE <sup>#</sup>	9,4115 <sup>1</sup>	-	-
Clase AEH <sup>#</sup>	8,9211 <sup>1</sup>	-	-
Clase DE <sup>#</sup>	9,3977 <sup>1</sup>	-	-
Clase DEH <sup>#</sup>	8,9080 <sup>1</sup>	-	-
Clase IE	13,3721 <sup>1</sup>	14,5096 <sup>1</sup>	9,0252 <sup>1</sup>
Clase IU	14,5652	16,0271	9,3071
Clase ZU	14,5355	16,0024	9,3012
Clase 1E	3,3587 <sup>1</sup>	3,6581 <sup>1</sup>	2,2925 <sup>1</sup>
Clase 1U	3,8923	4,2991	2,5152
Clase 2E	14,2828 <sup>1</sup>	15,5085 <sup>1</sup>	9,6601 <sup>1</sup>
Clase 2U	14,5227	15,9916	9,2995
Clase 3U	3,4970	3,8480	2,2346
Clase 8E	3,8299 <sup>1</sup>	4,1593 <sup>1</sup>	2,5930 <sup>1</sup>
Clase 8U	4,4411	4,8912	2,8455
Clase 9U	14,5928	16,0542	9,3192

<sup>1</sup> La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.<sup>#</sup> 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 2021

	Notas	2021 USD
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>343.930.526</b>
<b>Ingresos</b>		
Dividendos, neto	2	3.989.250
Interés bancario	2	228
<b>Total de ingresos</b>		<b>3.989.478</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.956.688)
Interés bancario	2	(118)
Impuestos extranjeros	3	(889.633)
Gastos operativos	3, 5	(237.040)
<b>Total de gastos</b>		<b>(3.083.479)</b>
<b>Ingresos netos de inversiones</b>		<b>905.999</b>
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		3.388.110
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(112)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(119.785)
<b>Ganancia neta realizada</b>		<b>3.268.213</b>
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(36.446.248)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(35)
<b>Cambio neto en (pérdida) no realizada</b>		<b>(36.446.283)</b>
<b>(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>(32.272.071)</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		31.557.505
Reembolsos de acciones		(28.315.277)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>3.242.228</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>314.900.683</b>

## VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	314.900.683	343.930.526	195.909.991

## Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities

### ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 USD
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	493.747.834
Efectivo en el banco	2	10.395.787
Por cobrar para la venta de inversiones		7.076.009
Suscripciones por cobrar		1.807.780
Interés y dividendos por cobrar, neto		330.231
<b>Total de activos</b>		<b>513.357.641</b>
<b>Pasivos</b>		
Pagadero por inversiones adquiridas		(317.997)
Reembolsos pagaderos		(9.611.496)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(1.420.661)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(277.595)
Otros pasivos	20	(154.907)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(11.782.656)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>501.574.985</b>

### NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	339,290
Clase AEH	36.050,656
Clase AU	84.439,351
Clase AUP	10.839,439
Clase DU	8.786,301
Clase IU	3.690.762,407
Clase XS	69,000
Clase XSH	7.219.424,080
Clase ZEH	455.019,128
Clase ZFH	48,000
Clase ZGH	35,000
Clase ZU	3.840.916,811

### ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AEC	18,3875 <sup>1</sup>	17,5161 <sup>1</sup>	11,3591 <sup>1</sup>
Clase AEH	30,2249 <sup>1</sup>	28,6186 <sup>1</sup>	18,3280 <sup>1</sup>
Clase AU	55,4138	52,1802	32,9720
Clase AUP	20,2120	19,1464	12,2618
Clase DU	27,5873	26,0427	16,5381
Clase IU	79,9451	74,9789	47,0024
Clase XS	19,4975 <sup>2</sup>	18,0154 <sup>2</sup>	11,8570 <sup>2</sup>
Clase XSH	19,6664 <sup>2</sup>	18,3848 <sup>2</sup>	11,4988 <sup>2</sup>
Clase ZEH	19,6750 <sup>1</sup>	18,5596 <sup>1</sup>	11,8015 <sup>1</sup>
Clase ZFH	19,2359 <sup>3</sup>	18,1775 <sup>3</sup>	11,5719 <sup>3</sup>
Clase ZGH	20,4353 <sup>4</sup>	19,2281 <sup>4</sup>	12,2135 <sup>4</sup>
Clase ZU	22,1681	20,7962	13,0432

<sup>1</sup> La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.<sup>2</sup> La clase está denominada en SGD. La divisa base de la Cartera es el USD.<sup>3</sup> La clase está denominada en CHF. La divisa base de la Cartera es el USD.<sup>4</sup> 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 2021

	Notas	2021 USD
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>484.292.226</b>
<b>Ingresos</b>		
Dividendos, neto	2	2.406.227
Interés bancario	2	1.453
<b>Total de ingresos</b>		<b>2.407.680</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.673.407)
Gastos operativos	3, 5	(657.375)
<b>Total de gastos</b>		<b>(2.330.782)</b>
<b>Ingresos netos de inversiones</b>		<b>76.898</b>
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		36.333.725
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		35.453
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		57.623
<b>Ganancia neta realizada</b>		<b>36.426.801</b>
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(3.214.610)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(1.455.222)
<b>Cambio neto en (pérdida) no realizada</b>		<b>(4.669.832)</b>
<b>Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>31.833.867</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		49.846.068
Reembolsos de acciones		(64.395.776)
Dividendos	7	(1.400)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>(14.551.108)</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>501.574.985</b>

### VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	501.574.985	484.292.226	462.376.758

## Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities

## ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 USD
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	71.111.568
Efectivo en el banco	2	1.080.178
Por cobrar para la venta de inversiones		761.010
Suscripciones por cobrar		92.615
Interés y dividendos por cobrar, neto		44.899
<b>Total de activos</b>		<b>73.090.270</b>
<b>Pasivos</b>		
Pagadero por inversiones adquiridas		(653.161)
Reembolsos pagaderos		(1.540.262)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(25.684)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(5.598)
Otros pasivos	20	(10.943)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(2.235.648)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>70.854.622</b>

## NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	1.819,435
Clase AEH	54,100
Clase AU	713,571
Clase AUP	341,965
Clase DE	12.896,196
Clase DEH	198,724
Clase DU	640,416
Clase IE	15.206,670
Clase IEC	58,100
Clase IEH	35.490,528
Clase IFH	59,100
Clase IG	20.312,253
Clase IU	57,576
Clase NE	65,000
Clase NG	3.300.181,091
Clase NU	1.076,000
Clase XG	701.059,000
Clase ZEH	54,100
Clase ZFH	60,100
Clase ZU	483,921

## ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 USD
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>26.554.871</b>
<b>Ingresos</b>		
Dividendos, neto	2	392.944
Interés bancario	2	16
<b>Total de ingresos</b>		<b>392.960</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(28.822)
Gastos operativos	3, 5	(31.612)
<b>Total de gastos</b>		<b>(60.434)</b>
<b>Ingresos netos de inversiones</b>		
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		804.321
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(7.711)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		13.907
<b>Ganancia neta realizada</b>		<b>810.517</b>
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		2.274.531
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(25.453)
<b>Cambio neto en ganancia no realizada</b>		<b>2.249.078</b>
<b>Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>3.392.121</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		45.674.224
Reembolsos de acciones		(4.766.538)
Dividendos	7	(56)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>40.907.630</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>70.854.622</b>

## VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	70.854.622	26.554.871	5.455.757

## Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities

### ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AE	16,6793 <sup>1</sup>	15,2404 <sup>1</sup>	10,9422 <sup>1</sup>
Clase AEH	15,7436 <sup>1</sup>	14,6709 <sup>1</sup>	9,9686 <sup>1</sup>
Clase AU	17,3389	16,0663	10,7691
Clase AUP	15,9059	14,8613	10,1509
Clase DE	16,5293 <sup>1</sup>	15,1186 <sup>1</sup>	10,8764 <sup>1</sup>
Clase DEH	15,6141 <sup>1</sup>	14,5633 <sup>1</sup>	9,9148 <sup>1</sup>
Clase DU	17,1905	15,9450	10,7091
Clase IE	16,9014 <sup>1</sup>	15,4165 <sup>1</sup>	11,0332 <sup>1</sup>
Clase IEC	14,6379 <sup>1</sup>	13,7286 <sup>1</sup>	9,4747 <sup>1</sup>
Clase IEH	15,9647 <sup>1</sup>	14,8479 <sup>1</sup>	10,0566 <sup>1</sup>
Clase IFH	15,8057 <sup>2</sup>	14,7157 <sup>2</sup>	9,9810 <sup>2</sup>
Clase IG	13,7072 <sup>3</sup>	12,3891 <sup>3</sup>	9,2032 <sup>3</sup>
Clase IU	17,6053	16,2814	10,8750
Clase NE	13,6004 <sup>1</sup>	12,3904 <sup>1</sup>	-
Clase NG	12,8140 <sup>3</sup>	11,5750 <sup>3</sup>	-
Clase NU	13,3430	12,3331	-
Clase XG	12,8645 <sup>3</sup>	11,6147 <sup>3</sup>	-
Clase ZEH	15,9133 <sup>1</sup>	14,8103 <sup>1</sup>	10,0367 <sup>1</sup>
Clase ZFH	15,7201 <sup>2</sup>	14,6448 <sup>2</sup>	9,9435 <sup>2</sup>
Clase ZU	17,5256	16,2192	10,8446

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

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

<sup>3</sup> 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 2021

	Notas	2021 EUR
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	437.441.084
Efectivo en el banco	2	2.213.760
Por cobrar para la venta de inversiones		7.188.762
Suscripciones por cobrar		161.761
Interés y dividendos por cobrar, neto		63.743
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	51.550
Otros activos	20	522.521
<b>Total de activos</b>		<b>447.643.181</b>
<b>Pasivos</b>		
Pagadero por inversiones adquiridas		(9.449.123)
Reembolsos pagaderos		(661.297)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(257.505)
Otros pasivos	20	(53.482)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(10.421.407)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>437.221.774</b>

### NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	149.871,511
Clase ASH	342.676,568
Clase AUH	7.885,167
Clase DE	147.426,395
Clase IE	2.465.089,081
Clase W	34.806,973
Clase XE	1.190.330,123
Clase ZE	85,000
Clase ZUH	2.325,637
Clase 1E	3.036.474,167
Clase 1EP	65,000
Clase 1G	170.784,657
Clase 1GP	59,000
Clase 2E	7.490.101,199
Clase 2G	492.010,142
Clase 2U	73,000
Clase 3E	436.567,901
Clase 3G	264.684,458
Clase 3GP	57,000
Clase 4E	873.499,911
Clase 4G	55,000
Clase 8E	261.172,428
Clase 8G	35.318,721
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 2021

	Notas	2021 EUR
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>386.572.137</b>
<b>Ingresos</b>		
Dividendos, neto	2	5.908.608
Interés bancario	2	2
<b>Total de ingresos</b>		<b>5.908.610</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.517.075)
Interés bancario	2	(5.964)
Gastos operativos	3, 5	(303.023)
<b>Total de gastos</b>		<b>(1.826.062)</b>
<b>Ingresos netos de inversiones</b>		<b>4.082.548</b>
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		8.821.013
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		72.412
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		13.216
<b>Ganancia neta realizada</b>		<b>8.906.641</b>
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		19.377.729
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(6.289)
<b>Cambio neto en ganancia no realizada</b>		<b>19.371.440</b>
<b>Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>32.360.629</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		65.037.683
Reembolsos de acciones		(46.748.675)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>18.289.008</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>437.221.774</b>

### VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
EUR	437.221.774	386.572.137	169.655.099

## Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities

### ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AE	84,8811	78,4220	55,8171
Clase ASH	24,3095 <sup>1</sup>	22,3960 <sup>1</sup>	15,8502 <sup>1</sup>
Clase AUH	29,1573 <sup>2</sup>	26,8262 <sup>2</sup>	18,8909 <sup>2</sup>
Clase DE	30,6164	28,3149	20,2086
Clase IE	60,0340	55,2576	39,0176
Clase W	71,1969	65,8450	46,8999
Clase XE	69,8632	64,0957	44,9324
Clase ZE <sup>#</sup>	9,9598	—	—
Clase ZUH	19,0438 <sup>2</sup>	17,4726 <sup>2</sup>	12,2253 <sup>2</sup>
Clase 1E	13,5131	12,4836	8,8812
Clase 1EP	13,2332	12,2262	8,8718
Clase 1G	12,9087 <sup>3</sup>	11,8186 <sup>3</sup>	8,7345 <sup>3</sup>
Clase 1GP	12,6447 <sup>3</sup>	11,5799 <sup>3</sup>	8,7278 <sup>3</sup>
Clase 2E	13,7615	12,6844	8,9747
Clase 2G	13,1450 <sup>3</sup>	12,0079 <sup>3</sup>	8,8258 <sup>3</sup>
Clase 2U	13,6688 <sup>2</sup>	12,7712 <sup>2</sup>	8,4323 <sup>2</sup>
Clase 3E	13,8195	12,7289	8,9937
Clase 3G	13,2008 <sup>3</sup>	12,0504 <sup>3</sup>	8,8448 <sup>3</sup>
Clase 3GP	12,9369 <sup>3</sup>	11,8079 <sup>3</sup>	8,8385 <sup>3</sup>
Clase 4E	14,1923	13,0161	9,1182
Clase 4G	13,5740 <sup>3</sup>	12,3357 <sup>3</sup>	8,9746 <sup>3</sup>
Clase 8E	13,7388	12,6660	8,9653
Clase 8G	13,1294 <sup>3</sup>	11,9961 <sup>3</sup>	8,8207 <sup>3</sup>
Clase 8U	13,6454 <sup>2</sup>	12,7491 <sup>2</sup>	8,4188 <sup>2</sup>
Clase 9E	13,8729	12,7770	9,0171
Clase 9G	13,2455 <sup>3</sup>	12,0896 <sup>3</sup>	8,8664 <sup>3</sup>
Clase 9GP	12,9954 <sup>3</sup>	11,8602 <sup>3</sup>	8,8664 <sup>3</sup>

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

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

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

<sup>#</sup> Consulte la nota 1.

## Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend

### ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 EUR
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	75.935.967
Efectivo en el banco	2	492.430
Por cobrar para la venta de inversiones		427.232
Suscripciones por cobrar		14.408
Interés y dividendos por cobrar, neto		71.642
Otros activos	20	228.860
<b>Total de activos</b>		<b>77.170.539</b>
<b>Pasivos</b>		
Pagadero por inversiones adquiridas		(506.128)
Reembolsos pagaderos		(68.006)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(54.529)
Otros pasivos	20	(9.855)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(638.518)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>76.532.021</b>

### NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	412,301
Clase AEP	10.773,759
Clase AUP	80,000
Clase DE	4.033,007
Clase DEP	2.612,826
Clase IE	1.465.060,968
Clase IEP	628.771,000
Clase ZE	35.002,221
Clase ZEP	15.672,000
Clase 1E	4.095.628,819
Clase 1EP	10.681.932,665
Clase 1G	148.086,551
Clase 1GP	341.246,982
Clase 2E	1.013.894,004
Clase 2EP	72,000
Clase 2G	58,000
Clase 2GP	63,000
Clase 3EP	71.251,006
Clase 3G	125.435,783
Clase 3GP	752.349,479
Clase 4GP	6.464.057,139
Clase 8E	279.121,001
Clase 8EP	957.618,357
Clase 8G	45.338,925
Clase 8GP	453.061,400
Clase 9EP	8.371,000
Clase 9G	57,000
Clase 9GP	63,000

### ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 EUR
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>72.471.914</b>
<b>Ingresos</b>		
Dividendos, neto	2	1.828.660
<b>Total de ingresos</b>		<b>1.828.660</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(352.514)
Interés bancario	2	(2.799)
Gastos operativos	3, 5	(63.700)
<b>Total de gastos</b>		<b>(419.013)</b>
<b>Ingresos netos de inversiones</b>		<b>1.409.647</b>
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		2.228.162
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(5.349)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(7.806)
<b>Ganancia neta realizada</b>		<b>2.215.007</b>
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(144.067)
<b>Cambio neto en (pérdida) no realizada</b>		<b>(144.067)</b>
<b>Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>3.480.587</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		10.867.356
Reembolsos de acciones		(9.394.754)
Dividendos	7	(893.082)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>579.520</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>76.532.021</b>

### VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
EUR	76.532.021	72.471.914	40.776.458

## Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend

### ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AE	12,7527	12,2123	8,4207
Clase AEP	11,3586	11,1512	7,9601
Clase AUP	11,9595 <sup>1</sup>	11,9099 <sup>1</sup>	7,9466 <sup>1</sup>
Clase DE	12,6151	12,1020	8,3747
Clase DEP	11,2280	11,0429	7,9168
Clase IE	13,0732	12,4632	8,5228
Clase IEP	11,6430	11,3788	8,0572
Clase ZE	13,0451	12,4458	8,5167
Clase ZEP	11,6056	11,3507	8,0497
Clase 1E	2,0808	1,9917	1,3718
Clase 1EP	1,1258	1,1057	0,7893
Clase 1G	1,7883 <sup>2</sup>	1,6964 <sup>2</sup>	1,2138 <sup>2</sup>
Clase 1GP	0,9692 <sup>2</sup>	0,9428 <sup>2</sup>	0,6989 <sup>2</sup>
Clase 2E	13,0282	12,4322	8,5107
Clase 2EP	11,6163	11,3572	8,0536
Clase 2G	12,7477 <sup>2</sup>	12,0502 <sup>2</sup>	8,5638 <sup>2</sup>
Clase 2GP	11,3435 <sup>2</sup>	10,9938 <sup>2</sup>	8,0970 <sup>2</sup>
Clase 3EP	1,8340	1,7928	1,2698
Clase 3G	1,7293 <sup>2</sup>	1,6343 <sup>2</sup>	1,1606 <sup>2</sup>
Clase 3GP	1,5671 <sup>2</sup>	1,5182 <sup>2</sup>	1,1214 <sup>2</sup>
Clase 4GP	1,3870 <sup>2</sup>	1,3394 <sup>2</sup>	0,9796 <sup>2</sup>
Clase 8E	2,2942	2,1897	1,4996
Clase 8EP	1,2259	1,1990	0,8512
Clase 8G	1,9735 <sup>2</sup>	1,8667 <sup>2</sup>	1,3280 <sup>2</sup>
Clase 8GP	1,0526 <sup>2</sup>	1,0208 <sup>2</sup>	0,7528 <sup>2</sup>
Clase 9EP	11,6720	11,4256	8,0816
Clase 9G	12,7918 <sup>2</sup>	12,0857 <sup>2</sup>	8,5782 <sup>2</sup>
Clase 9GP	11,3925 <sup>2</sup>	11,0352 <sup>2</sup>	8,1121 <sup>2</sup>

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

<sup>2</sup> 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 2021

	Notas	2021 EUR
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	1.020.799.041
Efectivo en el banco	2	1.309.387
Por cobrar para la venta de inversiones		2.492.124
Suscripciones por cobrar		1.309.780
Interés y dividendos por cobrar, neto		464.995
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	231.052
Otros activos	20	605.743
<b>Total de activos</b>		<b>1.027.212.122</b>
<b>Pasivos</b>		
Pagadero por inversiones adquiridas		(151.759)
Reembolsos pagaderos		(1.439.361)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(1.090.046)
Otros pasivos	20	(290.182)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(2.971.348)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>1.024.240.774</b>

### NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	7.298.058,200
Clase ASH	960.691,646
Clase AUH	32.718,877
Clase DE	1.367.920,452
Clase DUH	1.118,000
Clase IE	3.466.040,131
Clase W	9.106,330
Clase ZE	15.012.250,113
Clase ZFH	1.749,004

### ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AE	59,7381	53,6034	34,7061
Clase ASH	40,8262 <sup>1</sup>	36,5279 <sup>1</sup>	23,5023 <sup>1</sup>
Clase AUH	15,7585 <sup>2</sup>	14,0753 <sup>2</sup>	9,0044 <sup>2</sup>
Clase DE	53,6219	48,3327	31,5752
Clase DUH	15,3066 <sup>2</sup>	13,7346 <sup>2</sup>	8,8604 <sup>2</sup>
Clase IE	75,3402	67,3496	43,2819
Clase W	99,9027	89,6657	58,0840
Clase ZE	15,1520	13,5449	8,7046
Clase ZFH	14,5818 <sup>3</sup>	13,0545 <sup>3</sup>	8,4083 <sup>3</sup>

<sup>1</sup> La clase está denominada en SGD. La divisa base de la Cartera es el EUR.<sup>2</sup> La clase está denominada en USD. La divisa base de la Cartera es el EUR.<sup>3</sup> 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 2021

	Notas	2021 EUR
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>967.772.792</b>
<b>Ingresos</b>		
Dividendos, neto	2	7.598.921
Interés bancario	2	908
<b>Total de ingresos</b>		<b>7.599.829</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(6.326.569)
Interés bancario	2	(9.433)
Gastos operativos	3, 5	(1.672.941)
<b>Total de gastos</b>		<b>(8.008.943)</b>
<b>(Pérdida) neta de inversiones</b>		<b>(409.114)</b>
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		32.001.941
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		360.905
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		21.321
Ganancia neta realizada en reembolso de impuestos		17
<b>Ganancia neta realizada</b>		<b>32.384.184</b>
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		78.708.550
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(76.370)
<b>Cambio neto en ganancia no realizada</b>		<b>78.632.180</b>
<b>Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>110.607.250</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		146.541.442
Reembolsos de acciones		(200.680.710)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>(54.139.268)</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>1.024.240.774</b>

### VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
EUR	1.024.240.774	967.772.792	435.284.977

## Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies

### ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 EUR
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	2.237.336.439
Efectivo en el banco	2	410.652
Por cobrar para la venta de inversiones		697.910
Suscripciones por cobrar		2.169.651
Interés y dividendos por cobrar, neto		566.469
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	1.167.548
Otros activos	20	1.897.186
<b>Total de activos</b>		<b>2.244.245.855</b>
<b>Pasivos</b>		
Pagadero por inversiones adquiridas		(581.276)
Reembolsos pagaderos		(3.078.682)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(1.755.230)
Otros pasivos	20	(280.631)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(5.695.819)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>2.238.550.036</b>

### NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase IE	553.267,983
Clase ZE	1.707.935,800
Clase 1E	31.118.645,837
Clase 1EP	1.091.482,086
Clase 1FH	279.029,374
Clase 1G	803.392,933
Clase 1UH	2.519.826,480
Clase 2E	18.081.172,907
Clase 2G	56,000
Clase 3E	33.753.864,513
Clase 3EP	1.448.127,125
Clase 3FH	902.343,482
Clase 3G	2.465.802,046
Clase 3GP	261.038,756
Clase 3UH	1.344.461,602
Clase 4E	8.426.104,711
Clase 4G	1.833.462,096
Clase 8E	9.935.245,397
Clase 8G	641.426,782
Clase 9E	38.933.714,142
Clase 9EP	64,000
Clase 9FH	20.847,242
Clase 9G	927.888,277
Clase 9GP	57,000
Clase 9UH	251.744,816

### ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 EUR
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>1.980.272.935</b>
<b>Ingresos</b>		
Dividendos, neto	2	16.784.178
Interés bancario	2	663
<b>Total de ingresos</b>		<b>16.784.841</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(9.939.984)
Interés bancario	2	(11.027)
Gastos operativos	3, 5	(1.590.691)
<b>Total de gastos</b>		<b>(11.541.702)</b>
<b>Ingresos netos de inversiones</b>		<b>5.243.139</b>
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		5.360.662
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		732.815
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		56.219
<b>Ganancia neta realizada</b>		<b>6.149.696</b>
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		217.318.986
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		641.389
<b>Cambio neto en ganancia no realizada</b>		<b>217.960.375</b>
<b>Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>229.353.210</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		266.018.828
Reembolsos de acciones		(237.094.937)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>28.923.891</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>2.238.550.036</b>

### VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
EUR	2.238.550.036	1.980.272.935	922.670.066

## Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies

### ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase IE	14,5825	13,0732	8,6065
Clase ZE	14,1659	12,7094	8,3794
Clase 1E	13,9015	12,5109	8,2996
Clase 1EP	13,4201	12,0777	8,0712
Clase 1FH	13,7771 <sup>1</sup>	12,4182 <sup>1</sup>	8,2583 <sup>1</sup>
Clase 1G	13,2765 <sup>2</sup>	11,8416 <sup>2</sup>	8,1606 <sup>2</sup>
Clase 1UH	14,7221 <sup>3</sup>	13,1915 <sup>3</sup>	8,6456 <sup>3</sup>
Clase 2E	14,1801	12,7202	8,3840
Clase 2G	13,5588 <sup>2</sup>	12,0514 <sup>2</sup>	8,2490 <sup>2</sup>
Clase 3E	14,2523	12,7747	8,4066
Clase 3EP	13,7613	12,3346	8,1761
Clase 3FH	14,1268 <sup>1</sup>	12,6823 <sup>1</sup>	8,3663 <sup>1</sup>
Clase 3G	13,6101 <sup>2</sup>	12,0901 <sup>2</sup>	8,2649 <sup>2</sup>
Clase 3GP	13,1411 <sup>2</sup>	11,6735 <sup>2</sup>	8,0380 <sup>2</sup>
Clase 3UH	15,0875 <sup>3</sup>	13,4644 <sup>3</sup>	8,7556 <sup>3</sup>
Clase 4E	14,6265	13,0550	8,5195
Clase 4G	15,6328 <sup>2</sup>	13,8285 <sup>2</sup>	9,3745 <sup>2</sup>
Clase 8E	14,1654	12,7095	8,3804
Clase 8G	13,5286 <sup>2</sup>	12,0297 <sup>2</sup>	8,2400 <sup>2</sup>
Clase 9E	14,2717	12,7895	8,4130
Clase 9EP	13,7911	12,3547	8,1797
Clase 9FH	14,1441 <sup>1</sup>	12,6978 <sup>1</sup>	8,3720 <sup>1</sup>
Clase 9G	13,6317 <sup>2</sup>	12,1068 <sup>2</sup>	8,2730 <sup>2</sup>
Clase 9GP	13,1786 <sup>2</sup>	11,7010 <sup>2</sup>	8,0468 <sup>2</sup>
Clase 9UH	15,1153 <sup>3</sup>	13,4863 <sup>3</sup>	8,7665 <sup>3</sup>

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

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

<sup>3</sup> 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 2021

	Notas	2021 EUR
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	1.827.117.877
Efectivo en el banco	2	607.107
Por cobrar para la venta de inversiones		18.505.121
Suscripciones por cobrar		731.335
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	307.645
Otros activos	20	3.365.645
<b>Total de activos</b>		<b>1.850.634.730</b>
<b>Pasivos</b>		
Pagadero por inversiones adquiridas		(20.179.685)
Reembolsos pagaderos		(953.479)
Interés bancario pagadero		(2.125)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(2.028.746)
Otros pasivos	20	(212.265)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(23.376.300)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>1.827.258.430</b>

### NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	96.813,876
Clase AGH	183,395
Clase AUH	12.616,145
Clase DUH	66,000
Clase IE	1.443.113,444
Clase ZG	17.838,680
Clase ZGH	270.546,842
Clase 1E	76.780.632,478
Clase 1EP	795.109,965
Clase 1SH	3.019.672,817
Clase 1U	71.020,920
Clase 1UH	417.806,459
Clase 2E	11.336.229,682
Clase 2EP	79.176,000
Clase 3E	4.514.140,921
Clase 3U	534.218,738
Clase 8E	3.350.999,168
Clase 8EP	87.826,538
Clase 9E	11.654.235,158
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 2021

	Notas	2021 EUR
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>1.641.460.241</b>
<b>Ingresos</b>		
Dividendos, neto	2	13.452.581
Interés bancario	2	37
<b>Total de ingresos</b>		<b>13.452.618</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(11.614.977)
Interés bancario	2	(9.591)
Gastos operativos	3, 5	(1.208.713)
<b>Total de gastos</b>		<b>(12.833.281)</b>
<b>Ingresos netos de inversiones</b>		<b>619.337</b>
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		60.955.851
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		578.585
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		934
<b>Ganancia neta realizada</b>		<b>61.535.370</b>
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		116.523.470
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(148.353)
<b>Cambio neto en ganancia no realizada</b>		<b>116.375.117</b>
<b>Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>178.529.824</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		130.909.658
Reembolsos de acciones		(123.641.293)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>7.268.365</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>1.827.258.430</b>

### VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
EUR	1.827.258.430	1.641.460.241	1.246.832.227

## Threadneedle (Lux) - European Select

### ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AE	32,6226	29,4285	21,7556
Clase AGH	34,8521 <sup>1</sup>	31,3771 <sup>1</sup>	23,1092 <sup>1</sup>
Clase AUH	36,7590 <sup>2</sup>	33,0305 <sup>2</sup>	24,1474 <sup>2</sup>
Clase DUH	15,3889 <sup>2</sup>	13,8650 <sup>2</sup>	10,1924 <sup>2</sup>
Clase IE	47,2072	42,4042	31,0840
Clase ZG	16,0191 <sup>1</sup>	14,2678 <sup>1</sup>	10,8756 <sup>1</sup>
Clase ZGH	35,8500 <sup>1</sup>	32,1562 <sup>1</sup>	23,5152 <sup>1</sup>
Clase 1E	15,5568	14,0231	10,3514
Clase 1EP	14,9810	13,5040	10,0817
Clase 1SH	16,0877 <sup>3</sup>	14,4595 <sup>3</sup>	10,6075 <sup>3</sup>
Clase 1U	15,5695 <sup>2</sup>	14,2325 <sup>2</sup>	9,8084 <sup>2</sup>
Clase 1UH	16,4160 <sup>2</sup>	14,7401 <sup>2</sup>	10,7592 <sup>2</sup>
Clase 2E	15,8293	14,2266	10,4401
Clase 2EP	15,2562	13,7092	10,1699
Clase 3E	15,9141	14,2900	10,4678
Clase 3U	15,9250 <sup>2</sup>	14,5014 <sup>2</sup>	9,9173 <sup>2</sup>
Clase 8E	15,8114	14,2134	10,4345
Clase 8EP	15,2421	13,7016	10,1732
Clase 9E	15,9319	14,3031	10,4732
Clase 9U	15,9676 <sup>2</sup>	14,5368 <sup>2</sup>	9,9286 <sup>2</sup>

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

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

<sup>3</sup> 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 2021

	Notas	2021 EUR
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	2.060.670.732
Efectivo en el banco	2	2.810.588
Por cobrar para la venta de inversiones		10.776.856
Suscripciones por cobrar		1.326.444
Interés y dividendos por cobrar, neto		690.540
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	78.342
Otros activos	20	3.149.335
<b>Total de activos</b>		<b>2.079.502.837</b>
<b>Pasivos</b>		
Pagadero por inversiones adquiridas		(2.572.747)
Reembolsos pagaderos		(623.306)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(2.379.527)
Otros pasivos	20	(354.717)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(5.930.297)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>2.073.572.540</b>

### NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase IE	213.319,488
Clase ZE	1.125.123,456
Clase 1E	92.068.907,393
Clase 1EP	2.829.890,000
Clase 1FH	28.418,925
Clase 2E	6.886.511,443
Clase 3E	7.661.590,890
Clase 3EP	1.020.212,420
Clase 3FH	695.330,797
Clase 8E	7.511.970,730
Clase 9E	8.107.296,872
Clase 9EP	501.073,000
Clase 9FH	105,000

### ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase IE	14,6925	13,0435	8,4587
Clase ZE	16,3511	14,5269	9,4347
Clase 1E	16,0578	14,3106	9,3519
Clase 1EP	15,5284	13,8388	9,1237
Clase 1FH	15,9226 <sup>1</sup>	14,2143 <sup>1</sup>	9,3161 <sup>1</sup>
Clase 2E	16,3697	14,5412	9,4412
Clase 3E	16,3977	14,5559	9,4377
Clase 3EP	15,8835	14,0994	9,2225
Clase 3FH	16,3008 <sup>1</sup>	14,4944 <sup>1</sup>	9,4251 <sup>1</sup>
Clase 8E	16,3535	14,5297	9,4375
Clase 9E	16,4529	14,6020	9,4637
Clase 9EP	15,9049	14,1156	9,2293
Clase 9FH	16,3017 <sup>1</sup>	14,4918 <sup>1</sup>	9,4226 <sup>1</sup>

<sup>1</sup> 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 2021

	Notas	2021 EUR
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>1.932.987.086</b>
<b>Ingresos</b>		
Dividendos, neto	2	15.252.735
<b>Total de ingresos</b>		<b>15.252.735</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(13.663.575)
Interés bancario	2	(13.428)
Gastos operativos	3, 5	(2.030.261)
<b>Total de gastos</b>		<b>(15.707.264)</b>
<b>(Pérdida) neta de inversiones</b>		<b>(454.529)</b>
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		98.029.041
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		122.624
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		65.657
<b>Ganancia neta realizada</b>		<b>98.217.322</b>
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		135.864.300
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		78.152
<b>Cambio neto en ganancia no realizada</b>		<b>135.942.452</b>
<b>Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>233.705.245</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		106.218.739
Reembolsos de acciones		(199.338.530)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>(93.119.791)</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>2.073.572.540</b>

### VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
EUR	2.073.572.540	1.932.987.086	1.390.747.109

## Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income

## ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 USD
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	48.190.175
Efectivo en el banco	2	222.178
Por cobrar para la venta de inversiones		538.999
Suscripciones por cobrar		27.189
Interés y dividendos por cobrar, neto		59.730
Otros activos	20	748
<b>Total de activos</b>		<b>49.039.019</b>
<b>Pasivos</b>		
Reembolsos pagaderos		(10.490)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(74.499)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(24.956)
Impuestos a pagar	3	(85.691)
Otros pasivos	20	(833.170)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(1.028.806)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>48.010.213</b>

## NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	20.118,182
Clase AU	39.188,127
Clase AUP	20.947,166
Clase DEH	60.793,242
Clase DU	36.862,801
Clase DUP	21.164,267
Clase IEP	533.202,000
Clase IU	70,000
Clase W	25.604,957
Clase XU	1.341.544,014
Clase XUP	508.184,812
Clase ZG	51,000
Clase ZGH	6.917,198
Clase ZGP	56,000
Clase ZUP	3.626,994

## ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AEH	45,4495 <sup>1</sup>	49,6140 <sup>1</sup>	28,5781 <sup>1</sup>
Clase AU	114,0161	123,7850	70,3078
Clase AUP	13,6172	15,1272	8,9182
Clase DEH	32,1993 <sup>1</sup>	35,2821 <sup>1</sup>	20,4762 <sup>1</sup>
Clase DU	55,2981	60,2623	34,4843
Clase DUP	13,3093	14,8423	8,7791
Clase IEP	13,5180 <sup>1</sup>	14,7448 <sup>1</sup>	9,1986 <sup>1</sup>
Clase IU	13,1197	14,1867	7,9943
Clase W	84,3494	91,6683	52,1698
Clase XU	14,6082	15,7291	8,7885
Clase XUP	14,1632	15,6032	8,9896
Clase ZG	13,4708 <sup>2</sup>	14,2390 <sup>2</sup>	8,9304 <sup>2</sup>
Clase ZGH	25,7404 <sup>2</sup>	27,9288 <sup>2</sup>	15,9734 <sup>2</sup>
Clase ZGP	12,0126 <sup>2</sup>	12,9909 <sup>2</sup>	8,4224 <sup>2</sup>
Clase ZUP	15,7910	17,4725	10,1806

<sup>1</sup> La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.<sup>2</sup> 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 2021

	Notas	2021 USD
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>52.863.212</b>
<b>Ingresos</b>		
Dividendos, neto	2	1.076.016
Interés bancario	2	114
<b>Total de ingresos</b>		<b>1.076.130</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(148.970)
Interés bancario	2	(8)
Impuestos extranjeros	3	(85.787)
Gastos operativos	3, 5	(52.809)
<b>Total de gastos</b>		<b>(287.574)</b>
<b>Ingresos netos de inversiones</b>		<b>788.556</b>
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		1.108.814
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(53.896)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(31.379)
<b>Ganancia neta realizada</b>		<b>1.023.539</b>
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(5.892.756)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(25.931)
<b>Cambio neto en (pérdida) no realizada</b>		<b>(5.918.687)</b>
<b>(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>(4.106.592)</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		5.993.305
Reembolsos de acciones		(6.356.688)
Dividendos	7	(383.024)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>(746.407)</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>48.010.213</b>

## VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	48.010.213	52.863.212	41.795.505

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## Threadneedle (Lux) - Global Technology

### ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 USD
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	640.938.076
Efectivo en el banco	2	8.676.146
Por cobrar para la venta de inversiones		2.262.817
Suscripciones por cobrar		993.543
Interés y dividendos por cobrar, neto		229.594
Otros activos	20	1.228
<b>Total de activos</b>		<b>653.101.404</b>
<b>Pasivos</b>		
Reembolsos pagaderos		(2.522.675)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(2.847.990)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(773.065)
Otros pasivos	20	(152.141)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(6.295.871)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>646.805.533</b>

### NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	539.415,911
Clase AS	431.673,234
Clase AU	2.876.171,938
Clase AUP	27.463,373
Clase BU	59.701,277
Clase DEH	58.968,509
Clase DU	470.976,785
Clase IE	297.072,891
Clase IEH	3.228.079,024
Clase IG	5.561,913
Clase IU	5.239.876,617
Clase ZEH	62.739,603
Clase ZFH	93.984,000
Clase ZG	34,000
Clase ZU	1.387.594,647

### ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AEH	71,4454 <sup>1</sup>	67,4347 <sup>1</sup>	34,4250 <sup>1</sup>
Clase AS	24,7802 <sup>2</sup>	23,0106 <sup>2</sup>	12,2847 <sup>2</sup>
Clase AU	94,6780	88,8329	44,7525
Clase AUP	20,4058	19,1460	9,7092
Clase BU	119,7534	112,5857	56,9448
Clase DEH	20,5296 <sup>1</sup>	19,4109 <sup>1</sup>	9,9444 <sup>1</sup>
Clase DU	139,0851	130,7275	66,0879
Clase IE	15,9895 <sup>1</sup>	14,7271 <sup>1</sup>	7,8762 <sup>1</sup>
Clase IEH	24,1921 <sup>1</sup>	22,7318 <sup>1</sup>	11,5005 <sup>1</sup>
Clase IG	21,7457 <sup>3</sup>	19,8499 <sup>3</sup>	11,0263 <sup>3</sup>
Clase IU	16,6932	15,5922	7,7851
Clase ZEH	20,0644 <sup>1</sup>	18,8611 <sup>1</sup>	9,5567 <sup>1</sup>
Clase ZFH	23,4239 <sup>4</sup>	22,0485 <sup>4</sup>	11,1832 <sup>4</sup>
Clase ZG	21,6945 <sup>3</sup>	19,8092 <sup>3</sup>	11,01680 <sup>3</sup>
Clase ZU	43,1447	40,3192	20,1512

<sup>1</sup> La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.<sup>2</sup> La clase está denominada en SGD. La divisa base de la Cartera es el USD.<sup>3</sup> La clase está denominada en GBP. La divisa base de la Cartera es el USD.<sup>4</sup> 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 2021

	Notas	2021 USD
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>537.276.170</b>
<b>Ingresos</b>		
Dividendos, neto	2	1.707.129
Interés bancario	2	1.196
<b>Total de ingresos</b>		<b>1.708.325</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(4.365.076)
Gastos operativos	3, 5	(861.993)
<b>Total de gastos</b>		<b>(5.227.069)</b>
<b>(Pérdida) neta de inversiones</b>		<b>(3.518.744)</b>
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		30.315.680
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(1.506.227)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(2.031)
<b>Ganancia neta realizada</b>		<b>28.807.422</b>
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		8.946.802
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(1.267.984)
<b>Cambio neto en ganancia no realizada</b>		<b>7.678.818</b>
<b>Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>32.967.496</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		204.612.267
Reembolsos de acciones		(128.050.400)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>76.561.867</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>646.805.533</b>

### VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	646.805.533	537.276.170	275.490.723



## Threadneedle (Lux) - UK Equities

## ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 GBP
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	337.965.222
Efectivo en el banco	2	1.089.349
Por cobrar para la venta de inversiones		284.797
Suscripciones por cobrar		574.766
Interés y dividendos por cobrar, neto		534.775
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	278.413
<b>Total de activos</b>		<b>340.727.322</b>
<b>Pasivos</b>		
Pagadero por inversiones adquiridas		(665.184)
Reembolsos pagaderos		(597.071)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(223.653)
Otros pasivos	20	(50.025)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(1.535.933)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>339.191.389</b>

## NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	141.711,425
Clase AEH	347.853,644
Clase AFH	14.442,000
Clase AG	822.397,648
Clase AGP	75.902,106
Clase DEH	64.069,810
Clase DG	2.948,340
Clase IE	564.824,858
Clase IEH	266.275,668
Clase IG	1.308.283,946
Clase IGP	2.361.367,227
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	58.634,605
Clase ZEH	251.716,092
Clase ZFH	2.575,000
Clase ZG	429.934,353
Clase ZGP	1.282.283,106
Clase ZUH	86.959,355
Clase 3EH	2.186.840,260
Clase 3FH	42.371,000
Clase 3UH	1.949.039,231
Clase 9EH	8.452,000
Clase 9EP	4.737.627,979
Clase 9FH	6.085,000
Clase 9G	8.475.544,180
Clase 9UH	28.365,909

## ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 GBP
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>296.943.244</b>
<b>Ingresos</b>		
Dividendos, neto	2	5.649.000
Interés bancario	2	8
<b>Total de ingresos</b>		<b>5.649.008</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.309.522)
Interés bancario	2	(14)
Gastos operativos	3, 5	(287.442)
<b>Total de gastos</b>		<b>(1.596.978)</b>
<b>Ingresos netos de inversiones</b>		<b>4.052.030</b>
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		2.093.410
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(297.873)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(3.388)
<b>Ganancia neta realizada</b>		<b>1.792.149</b>
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		1.322.139
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		401.534
<b>Cambio neto en ganancia no realizada</b>		<b>1.723.673</b>
<b>Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>7.567.852</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		97.578.271
Reembolsos de acciones		(60.579.070)
Dividendos	7	(2.318.908)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>34.680.293</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>339.191.389</b>

## VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
GBP	339.191.389	296.943.244	206.285.143

## Threadneedle (Lux) - UK Equities

### ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AE	9,4180 <sup>1</sup>	9,2845 <sup>1</sup>	6,8397 <sup>1</sup>
Clase AEH	20,5708 <sup>1</sup>	20,1489 <sup>1</sup>	15,5141 <sup>1</sup>
Clase AFH	10,0177 <sup>2</sup>	9,8231 <sup>2</sup>	7,5610 <sup>2</sup>
Clase AG	28,6381	27,9800	21,4122
Clase AGP	21,1345	21,0118	16,5430
Clase DEH	9,7356 <sup>1</sup>	9,5731 <sup>1</sup>	7,4306 <sup>1</sup>
Clase DG	10,0420	9,8507	7,5987
Clase IE	10,0326 <sup>1</sup>	9,8435 <sup>1</sup>	7,1738 <sup>1</sup>
Clase IEH	31,0122 <sup>1</sup>	30,2322 <sup>1</sup>	23,0551 <sup>1</sup>
Clase IG	41,6698	40,5187	30,7157
Clase IGP	31,0744	30,7471	23,9808
Clase NEH	12,7086 <sup>1</sup>	12,3770 <sup>1</sup>	–
Clase NFH	12,6940 <sup>2</sup>	12,3746 <sup>2</sup>	–
Clase NG	12,7839	12,4164	–
Clase NGP	12,4379	12,2963	–
Clase NUH	12,8418 <sup>3</sup>	12,4477 <sup>3</sup>	–
Clase TEH	12,7076 <sup>1</sup>	12,3766 <sup>1</sup>	–
Clase TFH	12,6901 <sup>2</sup>	12,3738 <sup>2</sup>	–
Clase TG	12,7825	12,4163	–
Clase TGP	12,4358	12,2962	–
Clase TUH	12,8401 <sup>3</sup>	12,4472 <sup>3</sup>	–
Clase ZE	9,5332 <sup>1</sup>	9,3628 <sup>1</sup>	6,8468 <sup>1</sup>
Clase ZEH	12,7085 <sup>1</sup>	12,4008 <sup>1</sup>	9,4773 <sup>1</sup>
Clase ZFH	12,3002 <sup>2</sup>	12,0143 <sup>2</sup>	9,1823 <sup>2</sup>
Clase ZG	27,6524	26,9156	20,4444
Clase ZGP	11,1764	11,0735	8,6352
Clase ZUH	11,2076 <sup>3</sup>	10,8824 <sup>3</sup>	10,3032 <sup>3</sup>
Clase 3EH	1,8105 <sup>1</sup>	1,7651 <sup>1</sup>	1,3466 <sup>1</sup>
Clase 3FH	1,9432 <sup>2</sup>	1,8962 <sup>2</sup>	–
Clase 3UH	2,2306 <sup>3</sup>	2,1639 <sup>3</sup>	1,6280 <sup>3</sup>
Clase 9EH	10,8449 <sup>1</sup>	10,5716 <sup>1</sup>	8,0642 <sup>1</sup>
Clase 9EP	10,1403 <sup>1</sup>	10,1260 <sup>1</sup>	7,5850 <sup>1</sup>
Clase 9FH	10,8131 <sup>2</sup>	10,5498 <sup>2</sup>	8,0444 <sup>2</sup>
Clase 9G	10,3393	10,0527	7,6191
Clase 9UH	11,4732 <sup>3</sup>	11,1280 <sup>3</sup>	8,3708 <sup>3</sup>

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

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

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

## Threadneedle (Lux) - UK Equity Income

## ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 GBP
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	237.623.887
Efectivo en el banco	2	429.722
Suscripciones por cobrar		340.253
Interés y dividendos por cobrar, neto		592.904
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	359.280
<b>Total de activos</b>		<b>239.346.046</b>
<b>Pasivos</b>		
Reembolsos pagaderos		(1.065.009)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(148.799)
Otros pasivos	20	(43.247)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(1.257.055)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>238.088.991</b>

## NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	1.795.048,654
Clase AEC	65.649,711
Clase AEH	374.186,916
Clase AG	839.996,521
Clase ASC	133,600
Clase AUC	564.782,182
Clase DE	15.790,929
Clase DEC	90,600
Clase DEH	3.014,562
Clase DG	19.112,742
Clase DGP	72,000
Clase IE	1.525.580,022
Clase IEH	218.304,460
Clase IG	436.574,755
Clase IGP	1.290.884,218
Clase IU	368.618,403
Clase IUH	80,000
Clase LG	458.083,416
Clase LGP	10.405.924,017
Clase ZE	734.635,877
Clase ZEH	164.861,204
Clase ZFH	10.046,000
Clase ZG	198.863,824
Clase ZGP	17.404,032
Clase ZUH	127.508,780
Clase 1EH	316.350,603
Clase 1FH	29.059,102
Clase 1UH	71.203,464
Clase 3EH	174.205,699
Clase 3FH	40.290,742
Clase 3UH	295.370,097
Clase 9EH	42.173,000
Clase 9FH	81,000
Clase 9G	1.282.971,075
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 2021

	Notas	2021 GBP
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>203.529.182</b>
<b>Ingresos</b>		
Dividendos, neto	2	4.446.956
Interés bancario	2	8
<b>Total de ingresos</b>		<b>4.446.964</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(866.405)
Interés bancario	2	(1)
Gastos operativos	3, 5	(246.653)
<b>Total de gastos</b>		<b>(1.113.059)</b>
<b>Ingresos netos de inversiones</b>		<b>3.333.905</b>
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(2.011.092)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(208.708)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(4.940)
<b>(Pérdida) neta realizada</b>		<b>(2.224.740)</b>
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		17.432.096
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		458.516
<b>Cambio neto en ganancia no realizada</b>		<b>17.890.612</b>
<b>Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>18.999.777</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		65.898.683
Reembolsos de acciones		(48.080.234)
Dividendos	7	(2.258.417)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>15.560.032</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>238.088.991</b>

## VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
GBP	238.088.991	203.529.182	149.344.890

## Threadneedle (Lux) - UK Equity Income

### ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AE	12,4666 <sup>1</sup>	11,6608 <sup>1</sup>	8,7982 <sup>1</sup>
Clase AEC	9,8444 <sup>1</sup>	9,3261 <sup>1</sup>	7,5630 <sup>1</sup>
Clase AEH	11,6449 <sup>1</sup>	10,8296 <sup>1</sup>	8,5501 <sup>1</sup>
Clase AG	12,1840	11,2947	8,8527
Clase ASC	10,2276 <sup>2</sup>	9,6533 <sup>2</sup>	7,8020 <sup>2</sup>
Clase AUC	10,7286 <sup>3</sup>	10,1151 <sup>3</sup>	8,1166 <sup>3</sup>
Clase DE	12,0112 <sup>1</sup>	11,2772 <sup>1</sup>	8,5721 <sup>1</sup>
Clase DEC	9,4353 <sup>1</sup>	8,9790 <sup>1</sup>	7,3487 <sup>1</sup>
Clase DEH	11,2132 <sup>1</sup>	10,4678 <sup>1</sup>	8,3235 <sup>1</sup>
Clase DG	11,7419	10,9259	8,6278
Clase DGP	10,2775	9,7473	7,9234
Clase IE	13,0655 <sup>1</sup>	12,1630 <sup>1</sup>	9,0906 <sup>1</sup>
Clase IEH	12,2037 <sup>1</sup>	11,2958 <sup>1</sup>	8,8310 <sup>1</sup>
Clase IG	12,7954	11,8052	9,1656
Clase IGP	10,7898	10,1383	8,0999
Clase IU	13,5179 <sup>3</sup>	12,7617 <sup>3</sup>	8,9046 <sup>3</sup>
Clase IUH	12,9091 <sup>3</sup>	11,8874 <sup>3</sup>	9,1572 <sup>3</sup>
Clase LG	12,8854	11,8792	9,2094
Clase LGP	10,8479	10,1870	8,1168
Clase ZE	12,9435 <sup>1</sup>	12,0615 <sup>1</sup>	9,0335 <sup>1</sup>
Clase ZEH	12,0960 <sup>1</sup>	11,2040 <sup>1</sup>	8,7774 <sup>1</sup>
Clase ZFH	11,8991 <sup>4</sup>	11,0386 <sup>4</sup>	8,6609 <sup>4</sup>
Clase ZG	12,6578	11,6899	9,0942
Clase ZGP	11,2151	10,5523	8,4466
Clase ZUH	13,2553 <sup>3</sup>	12,2225 <sup>3</sup>	9,5384 <sup>3</sup>
Clase 1EH	11,5271 <sup>1</sup>	10,7111 <sup>1</sup>	8,4410 <sup>1</sup>
Clase 1FH	11,4499 <sup>4</sup>	10,6537 <sup>4</sup>	8,4075 <sup>4</sup>
Clase 1UH	12,1993 <sup>3</sup>	11,2829 <sup>3</sup>	8,7794 <sup>3</sup>
Clase 3EH	11,7933 <sup>1</sup>	10,9193 <sup>1</sup>	8,5370 <sup>1</sup>
Clase 3FH	11,7102 <sup>4</sup>	10,8540 <sup>4</sup>	8,5004 <sup>4</sup>
Clase 3UH	12,4845 <sup>3</sup>	11,5019 <sup>3</sup>	8,8809 <sup>3</sup>
Clase 9EH	11,8012 <sup>1</sup>	10,9227 <sup>1</sup>	8,5371 <sup>1</sup>
Clase 9FH	11,7071 <sup>4</sup>	10,8516 <sup>4</sup>	8,4985 <sup>4</sup>
Clase 9G	11,4364	10,5508	8,1909
Clase 9UH	12,4838 <sup>3</sup>	11,4992 <sup>3</sup>	8,8800 <sup>3</sup>

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

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

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

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

## Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity\*

## ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 USD
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	81.391
Efectivo en el banco	2	1.532.949
Interés y dividendos por cobrar, neto		4
Otros activos	20	21.106
<b>Total de activos</b>		<b>1.635.450</b>
<b>Pasivos</b>		
Otros pasivos	20	(472)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(472)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>1.634.978</b>

## NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase IU	398.459,064
Clase ZU	12.351,905

## ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase IU	3,9799	3,8047	2,9775
Clase ZU	3,9804	3,8053	2,9779

## ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 USD
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>6.857.182</b>
<b>Ingresos</b>		
Dividendos, neto	2	94.714
Interés bancario	2	91
Otros ingresos		21.106
<b>Total de ingresos</b>		<b>115.911</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(17.778)
Interés bancario	2	(3)
Gastos operativos	3, 5	(7.763)
<b>Total de gastos</b>		<b>(25.544)</b>
<b>Ingresos netos de inversiones</b>		<b>90.367</b>
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(52.037)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(2.311)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(22.587)
<b>(Pérdida) neta realizada</b>		<b>(76.935)</b>
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		290.164
<b>Cambio neto en ganancia no realizada</b>		<b>290.164</b>
<b>Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>303.596</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		14.466
Reembolsos de acciones		(5.540.266)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>(5.525.800)</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>1.634.978</b>

## VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	1.634.978	6.857.182	5.920.259

\* Consulte la nota 1.

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha

### ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 USD
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	20.428.256
Efectivo en el banco	2	972.166
Depósitos a plazo	2, 19	1.750.767
Suscripciones por cobrar		56
Interés por cobrar en swaps	2	201
Interés y dividendos por cobrar, neto		4.770
Ganancia neta no realizada en swaps	2, 10	34.376
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	407.990
<b>Total de activos</b>		<b>23.598.582</b>
<b>Pasivos</b>		
Descubiertos bancarios	2	(38.650)
Pagadero por inversiones adquiridas		(63.642)
Interés pagadero en swaps	2	(5.912)
Dividendo pagadero en swaps	2	(26.819)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(517.834)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(8.174)
Comisiones de rendimiento pagaderas	8	(10.871)
Otros pasivos	20	(3.566)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(675.468)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>22.923.114</b>

### NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	41.873,425
Clase AFH	764,000
Clase AGH	1.210,670
Clase AU	104.301,653
Clase DEH	7.834,051
Clase DU	77.405,916
Clase IEH	36.560,306
Clase IGH	78.666,376
Clase IU	36.741,259
Clase XGH	986.579,917
Clase ZE	80,000
Clase ZEH	83,000
Clase ZGH	2.403,309
Clase ZU	100,000

### ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AEH	15,8596 <sup>1</sup>	15,3714 <sup>1</sup>	14,9909 <sup>1</sup>
Clase AFH	14,4203 <sup>2</sup>	13,9949 <sup>2</sup>	13,6841 <sup>2</sup>
Clase AGH	16,9809 <sup>3</sup>	16,4018 <sup>3</sup>	15,9091 <sup>3</sup>
Clase AU	17,9167	17,2872	16,6795
Clase DEH	12,2609 <sup>1</sup>	11,9135 <sup>1</sup>	11,6756 <sup>1</sup>
Clase DU	13,7468	13,2965	12,8939
Clase IEH	23,0786 <sup>1</sup>	22,2720 <sup>1</sup>	21,5363 <sup>1</sup>
Clase IGH	24,4505 <sup>3</sup>	23,5814 <sup>3</sup>	22,6795 <sup>3</sup>
Clase IU	25,7361	24,8005	23,7275
Clase XGH	10,8968 <sup>3</sup>	10,4372 <sup>3</sup>	9,9603 <sup>3</sup>
Clase ZE	10,6712 <sup>1</sup>	10,1161 <sup>1</sup>	10,3731 <sup>1</sup>
Clase ZEH	10,0732 <sup>1</sup>	9,7263 <sup>1</sup>	9,4119 <sup>1</sup>
Clase ZGH	16,7833 <sup>3</sup>	16,1525 <sup>3</sup>	15,5508 <sup>3</sup>
Clase ZU	10,7135	10,3329	9,8971

<sup>1</sup> La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.<sup>2</sup> La clase está denominada en CHF. La divisa base de la Cartera es el USD.<sup>3</sup> 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 2021

	Notas	2021 USD
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>103.961.830</b>
<b>Ingresos</b>		
Dividendos, neto	2	84.062
Interés bancario	2	1.170
Ingresos por intereses en swaps		5.618
Otros ingresos		461.019
<b>Total de ingresos</b>		<b>551.869</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(51.167)
Comisiones de rendimiento	8	(10.870)
Interés bancario	2	(176)
Dividendos pagados en swaps		(88.516)
Gastos por intereses en swaps		(8.709)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(12.975)
Gastos operativos	3, 5	(38.179)
<b>Total de gastos</b>		<b>(210.592)</b>
<b>Ingresos netos de inversiones</b>		<b>341.277</b>
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		29.289.565
(Pérdida) neta realizada en swaps		(467.858)
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		2.211.955
(Pérdida) neta realizada en contratos de futuros		(2.923.622)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(462.887)
<b>Ganancia neta realizada</b>		<b>27.647.153</b>
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(25.404.200)
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		385.410
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(236.187)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		828.328
<b>Cambio neto en (pérdida) no realizada</b>		<b>(24.426.649)</b>
<b>Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>3.561.781</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		192.318
Reembolsos de acciones		(84.792.815)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>(84.600.497)</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>22.923.114</b>

### VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	22.923.114	103.961.830	180.468.553

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

### ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 EUR
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	1.104.464.093
Efectivo en el banco	2	63.171.625
Depósitos a plazo	2, 19	45.962.508
Por cobrar para la venta de inversiones		4.961.955
Suscripciones por cobrar		924.613
Interés por cobrar en swaps	2	337.887
Interés y dividendos por cobrar, neto		11.209.427
Pago por adelantado abonado en swaps	2	930.484
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	9.384.327
Otros activos	20	175
<b>Total de activos</b>		<b>1.241.347.094</b>
<b>Pasivos</b>		
Pagadero por inversiones adquiridas		(17.763.841)
Reembolsos pagaderos		(527.968)
Interés pagadero en swaps	2	(948.354)
Pago por adelantado cobrado en swaps	2	(1.103.842)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(636.414)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(41.644.583)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(542.400)
Otros pasivos	20	(81.851)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(63.249.253)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>1.178.097.841</b>

### NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	85,000
Clase IE	85,000
Clase ZE	76.300,479
Clase 1E	14.490.808,437
Clase 1EP	95.834,766
Clase 1GH	126.490,064
Clase 1UH	251.613,041
Clase 2E	69.001.917,338
Clase 2EP	90,000
Clase 2GC	76,000
Clase 2GH	10.744,040
Clase 4GH	242.001,138
Clase 8E	29.136.953,204
Clase 8EP	121.516,811
Clase 8GC	47.178,249
Clase 8GH	1.023.049,922

### ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 EUR	
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>1.105.181.704</b>	
<b>Ingresos</b>			
Dividendos, neto	2	4.212	
Interés sobre bonos, neto	2	17.751.218	
Interés bancario	2	202	
Ingresos por intereses en swaps		335.743	
<b>Total de ingresos</b>		<b>18.091.375</b>	
<b>Gastos</b>			
Comisiones de gestión de activos	5	(3.259.225)	
Interés bancario	2	(283.894)	
Gastos por intereses en swaps		(10.258.362)	
Gastos por intereses en contratos de futuros		(416.009)	
Gastos operativos	3, 5	(493.892)	
<b>Total de gastos</b>		<b>(14.711.382)</b>	
<b>Ingresos netos de inversiones</b>		<b>3.379.993</b>	
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(273.181)	
Ganancia neta realizada en swaps		2.592.173	
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(2.793.846)	
(Pérdida) neta realizada en contratos de futuros		(7.813.606)	
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(127.031)	
<b>(Pérdida) neta realizada</b>		<b>(8.415.491)</b>	
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(72.804)	
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en swaps		(2.966.604)	
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		2.537.745	
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		5.603.083	
<b>Cambio neto en ganancia no realizada</b>		<b>5.101.420</b>	
<b>Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>65.922</b>	
<b>Movimientos de capital</b>			
Suscripciones de acciones		152.532.289	
Reembolsos de acciones		(79.682.074)	
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>72.850.215</b>	
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>1.178.097.841</b>	
<b>VALOR LIQUIDATIVO TOTAL</b>			
	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
EUR	1.178.097.841	1.105.181.704	1.551.456.289

## Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

### ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AE <sup>#</sup>	9,9952	–	–
Clase IE <sup>#</sup>	10,0026	–	–
Clase ZE	10,2074	10,2122	9,3241
Clase 1E	10,0937	10,1181	9,2723
Clase 1EP	9,2310	9,2533	8,7619
Clase 1GH	10,3309 <sup>1</sup>	10,3276 <sup>1</sup>	9,4190 <sup>1</sup>
Clase 1UH	10,6470 <sup>2</sup>	10,6393 <sup>2</sup>	9,6685 <sup>2</sup>
Clase 2E	10,2863	10,2797	9,3632
Clase 2EP	9,3837	9,3705	8,8321
Clase 2GC	9,5781 <sup>1</sup>	9,5453 <sup>1</sup>	8,9432 <sup>1</sup>
Clase 2GH	10,5281 <sup>1</sup>	10,4925 <sup>1</sup>	9,5119 <sup>1</sup>
Clase 4GH	10,6931 <sup>1</sup>	10,6305 <sup>1</sup>	9,5888 <sup>1</sup>
Clase 8E	10,2696	10,2650	9,3536
Clase 8EP	9,3994	9,3952	8,8706
Clase 8GC	9,6111 <sup>1</sup>	9,5801 <sup>1</sup>	8,9861 <sup>1</sup>
Clase 8GH	10,5178 <sup>1</sup>	10,4843 <sup>1</sup>	9,5069 <sup>1</sup>

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

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

<sup>#</sup> Consulte la nota 1.



## Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities

## ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 EUR
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	52.515.935
Efectivo en el banco	2	4.329.549
Interés por cobrar en swaps	2	9.996
Interés y dividendos por cobrar, neto		374.331
Pago por adelantado abonado en swaps	2	82.240
Ganancia neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	680.534
<b>Total de activos</b>		<b>57.992.585</b>
<b>Pasivos</b>		
Pagadero por inversiones adquiridas		(99.829)
Interés pagadero en swaps	2	(31.607)
Pago por adelantado cobrado en swaps	2	(97.433)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(435.880)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(1.531.274)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(1.203)
Otros pasivos	20	(7.054)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(2.204.280)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>55.788.305</b>

## NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	374,659
Clase AFH	92,200
Clase AKH	84,000
Clase ANH	830,000
Clase AUH	92,000
Clase DE	5.644,054
Clase IE	374.978,780
Clase IEP	89,999
Clase IGH	67,800
Clase INH	826,000
Clase IU	92,000
Clase IUH	90,000
Clase JE	80,997
Clase JGH	67,800
Clase JUH	91,000
Clase LE	9.581,001
Clase LEP	89,320
Clase LGH	67,800
Clase XE	305.450,604
Clase XGH	3.978.364,993
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 2021

	Notas	2021 EUR
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>53.361.804</b>
<b>Ingresos</b>		
Interés sobre bonos, neto	2	663.649
Interés bancario	2	57
Ingresos por intereses en swaps		17.922
Otros ingresos		2
<b>Total de ingresos</b>		<b>681.630</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(6.903)
Interés bancario	2	(10.856)
Gastos por intereses en swaps		(370.092)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(7.031)
Gastos operativos	3, 5	(42.529)
<b>Total de gastos</b>		<b>(437.411)</b>
<b>Ingresos netos de inversiones</b>		<b>244.219</b>
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		150.614
Ganancia neta realizada en swaps		4.020
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		379.879
(Pérdida) neta realizada en contratos de futuros		(560.082)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(22.104)
<b>(Pérdida) neta realizada</b>		<b>(47.673)</b>
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		75.451
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en swaps		(88.885)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(784.902)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de futuros		389.680
<b>Cambio neto en (pérdida) no realizada</b>		<b>(408.656)</b>
<b>(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>(212.110)</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		2.925.161
Reembolsos de acciones		(286.528)
Dividendos	7	(22)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>2.638.611</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>55.788.305</b>

## VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
EUR	55.788.305	53.361.804	65.678.771

## Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities

### ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AE	10,1919	10,2349	9,4969
Clase AFH	10,0753 <sup>1</sup>	10,1268 <sup>1</sup>	9,4156 <sup>1</sup>
Clase AKH	102,0790 <sup>2</sup>	102,3358 <sup>2</sup>	94,6358 <sup>2</sup>
Clase ANH	10,3450 <sup>3</sup>	10,3661 <sup>3</sup>	9,5560 <sup>3</sup>
Clase AUH	10,8872 <sup>4</sup>	10,8977 <sup>4</sup>	10,0302 <sup>4</sup>
Clase DE	9,9934	10,0608	9,3822
Clase IE	10,4279	10,4353	9,6157
Clase IEP	9,3723	9,4983	9,0726
Clase IGH	10,7189 <sup>5</sup>	10,6920 <sup>5</sup>	9,8133 <sup>5</sup>
Clase INH	10,4185 <sup>3</sup>	10,4013 <sup>3</sup>	9,5374 <sup>3</sup>
Clase IU	10,7100 <sup>4</sup>	10,8726 <sup>4</sup>	9,3587 <sup>4</sup>
Clase IUH	11,1160 <sup>4</sup>	11,0910 <sup>4</sup>	10,1441 <sup>4</sup>
Clase JE	10,4073	10,4159	9,6164
Clase JGH	10,7300 <sup>5</sup>	10,6939 <sup>5</sup>	9,8127 <sup>5</sup>
Clase JUH	11,0642 <sup>4</sup>	11,0321 <sup>4</sup>	10,1046 <sup>4</sup>
Clase LE	10,4805	10,4800	9,6450
Clase LEP	9,4685	9,5877	9,1359
Clase LGH	10,7774 <sup>5</sup>	10,7382 <sup>5</sup>	9,8349 <sup>5</sup>
Clase XE	10,7999	10,7859	–
Clase XGH	10,4569 <sup>5</sup>	10,4148 <sup>5</sup>	9,5116 <sup>5</sup>
Clase XUH	10,9269 <sup>4</sup>	10,8737 <sup>4</sup>	–
Clase YE	10,3780	10,3910	9,5989
Clase YGH	10,6664 <sup>5</sup>	10,6432 <sup>5</sup>	9,7812 <sup>5</sup>
Clase YUH	11,0081 <sup>4</sup>	10,9872 <sup>4</sup>	10,0801 <sup>4</sup>
Clase ZE	10,3645	10,3835	9,5865
Clase ZFH	10,2338 <sup>1</sup>	10,2620 <sup>1</sup>	9,4998 <sup>1</sup>
Clase ZGH	10,6814 <sup>5</sup>	10,6642 <sup>5</sup>	9,7911 <sup>5</sup>
Clase ZUH	11,0650 <sup>4</sup>	11,0490 <sup>4</sup>	10,1215 <sup>4</sup>

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

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

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

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

<sup>5</sup> 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 2021

	Notas	2021 EUR
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	141.991.260
Efectivo en el banco	2	1.250.831
Por cobrar para la venta de inversiones		3.006.835
Suscripciones por cobrar		256.725
Interés por cobrar en swaps	2	6.018.562
Ganancia neta no realizada en swaps	2, 10	1.503.463
Otros activos	20	127.103
<b>Total de activos</b>		<b>154.154.779</b>
<b>Pasivos</b>		
Pagadero por inversiones adquiridas		(1.932.931)
Reembolsos pagaderos		(617.617)
Interés pagadero en swaps	2	(2.474.441)
Dividendo pagadero en swaps	2	(207.570)
Interés bancario pagadero		(3.156)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(109.971)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(135.617)
Comisiones de rendimiento pagaderas	8	(765.132)
Otros pasivos	20	(34.183)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(6.280.618)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>147.874.161</b>

### NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	4.859.430,544
Clase AEP	18.867,010
Clase AUH	4.007,000
Clase DE	1.682.968,364
Clase IE	2.198.053,115
Clase IGH	52.270,811
Clase LE	1.493.004,591
Clase XGH	766.233,588
Clase ZE	271.935,842
Clase ZF	76,000
Clase ZFH	6.377,000
Clase ZGH	57,000

### ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AE	12,5365	11,9823	11,8815
Clase AEP	12,8906	12,3580	12,2004
Clase AUH	13,4788 <sup>1</sup>	12,8933 <sup>1</sup>	12,6049 <sup>1</sup>
Clase DE	12,2691	11,7839	11,6749
Clase IE	13,0575	12,5007	12,2490
Clase IGH	13,3651 <sup>2</sup>	12,7513 <sup>2</sup>	12,4217 <sup>2</sup>
Clase LE	13,2485	12,6752	12,3472
Clase XGH	14,6765 <sup>2</sup>	13,8662 <sup>2</sup>	13,3602 <sup>2</sup>
Clase ZE	13,1054	12,5092	12,2555
Clase ZF	12,5431 <sup>3</sup>	12,2367 <sup>3</sup>	11,4828 <sup>3</sup>
Clase ZFH	12,3349 <sup>3</sup>	11,8267 <sup>3</sup>	11,6341 <sup>3</sup>
Clase ZGH	13,5438 <sup>2</sup>	12,7204 <sup>2</sup>	12,3878 <sup>2</sup>

<sup>1</sup> La clase está denominada en USD. La divisa base de la Cartera es el EUR.<sup>2</sup> La clase está denominada en GBP. La divisa base de la Cartera es el EUR.<sup>3</sup> 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 2021

	Notas	2021 EUR
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>235.387.755</b>
<b>Ingresos</b>		
Dividendos, neto	2	1.764.902
Interés bancario	2	12
Ingresos por intereses en swaps		24.261
Otros ingresos		236.518
<b>Total de ingresos</b>		<b>2.025.693</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(949.695)
Comisiones de rendimiento	8	(668.299)
Interés bancario	2	(23.141)
Dividendos pagados en swaps		(1.461.055)
Gastos por intereses en swaps		(344.604)
Gastos operativos	3, 5	(249.857)
<b>Total de gastos</b>		<b>(3.696.651)</b>
<b>(Pérdida) neta de inversiones</b>		<b>(1.670.958)</b>
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		26.855.001
(Pérdida) neta realizada en swaps		(11.570.630)
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		355.028
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(241.361)
<b>Ganancia neta realizada</b>		<b>15.398.038</b>
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(8.527.861)
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		3.725.747
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(999.052)
<b>Cambio neto en (pérdida) no realizada</b>		<b>(5.801.166)</b>
<b>Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>7.925.914</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		29.338.107
Reembolsos de acciones		(124.777.615)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>(95.439.508)</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>147.874.161</b>

### VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
EUR	147.874.161	235.387.755	145.122.405

## Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha

## ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 USD
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	113.880.059
Efectivo en el banco	2	2.615.495
Suscripciones por cobrar		64.035
Interés por cobrar en swaps	2	357.160
Interés y dividendos por cobrar, neto		14.646
Otros activos	20	2
<b>Total de activos</b>		<b>116.931.397</b>
<b>Pasivos</b>		
Pagadero por inversiones adquiridas		(222.149)
Reembolsos pagaderos		(35.121)
Interés pagadero en swaps	2	(531.448)
Dividendo pagadero en swaps	2	(15.298)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(53.753)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(1.371.764)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(130.233)
Otros pasivos	20	(17.120)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(2.376.886)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>114.554.511</b>

## NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	396,833
Clase AU	1.878,961
Clase DEH	650,687
Clase DU	20.825,245
Clase IU	75.378,095
Clase ZU	57,000
Clase 1E	3.774.492,225
Clase 1EH	381.870,557
Clase 1U	5.750.737,850
Clase 2E	49,000
Clase 2U	56,000
Clase 3U	45.196,000
Clase 8E	332.985,175
Clase 8U	2.181.936,018
Clase 9U	56,000

## ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AEH	16,4102 <sup>1</sup>	14,7944 <sup>1</sup>	9,6105 <sup>1</sup>
Clase AU	17,2626	15,4832	9,9317
Clase DEH	16,1885 <sup>1</sup>	14,6365 <sup>1</sup>	9,5551 <sup>1</sup>
Clase DU	17,0220	15,3058	9,8657
Clase IU	17,6855	15,7911	10,0392
Clase ZU	17,6246	15,7432	10,0184
Clase 1E	7,7273 <sup>1</sup>	6,8306 <sup>1</sup>	4,6882 <sup>1</sup>
Clase 1EH	5,9714 <sup>1</sup>	5,3803 <sup>1</sup>	3,4943 <sup>1</sup>
Clase 1U	8,9540	8,0266	5,1432
Clase 2E	17,4220 <sup>1</sup>	15,3339 <sup>1</sup>	10,4354 <sup>1</sup>
Clase 2U	17,7457	15,8326	10,0509
Clase 3U	5,0456	4,5061	2,8659
Clase 8E	8,5010 <sup>1</sup>	7,4837 <sup>1</sup>	5,0947 <sup>1</sup>
Clase 8U	9,7915	8,7414	5,5557
Clase 9U	17,7048	15,8025	10,0466

<sup>1</sup> 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 2021

	Notas	2021 USD
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>112.622.890</b>
<b>Ingresos</b>		
Dividendos, neto	2	276.975
Interés bancario	2	319
<b>Total de ingresos</b>		<b>277.294</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(789.772)
Interés bancario	2	(17)
Dividendos pagados en swaps		(51.936)
Gastos por intereses en swaps		(68.076)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(1.067)
Gastos operativos	3, 5	(104.275)
<b>Total de gastos</b>		<b>(1.015.143)</b>
<b>(Pérdida) neta de inversiones</b>		<b>(737.849)</b>
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		35.349.464
Ganancia neta realizada en swaps		3.145.123
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(48.628)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(9.508)
<b>Ganancia neta realizada</b>		<b>38.436.451</b>
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(23.131.681)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en swaps		(1.272.771)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		4.638
<b>Cambio neto en (pérdida) no realizada</b>		<b>(24.399.814)</b>
<b>Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>13.298.788</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		8.786.603
Reembolsos de acciones		(20.153.770)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>(11.367.167)</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>114.554.511</b>

## VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	114.554.511	112.622.890	107.950.260

## Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha

## ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 USD
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	90.585.445
Efectivo en el banco	2	3.618.588
Depósitos a plazo	2, 19	16.250.427
Por cobrar para la venta de inversiones		428.264
Suscripciones por cobrar		94.199
Interés por cobrar en swaps	2	68.354
Interés y dividendos por cobrar, neto		88.750
Otros activos	20	44.511
<b>Total de activos</b>		<b>111.178.538</b>
<b>Pasivos</b>		
Reembolsos pagaderos		(14.717)
Interés pagadero en swaps	2	(1.085.394)
Dividendo pagadero en swaps	2	(103.413)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(58.638)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(2.005.131)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(138.611)
Impuestos a pagar	3	(54.071)
Otros pasivos	20	(18.160)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(3.478.135)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>107.700.403</b>

## NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	143.102,673
Clase AU	15.894,673
Clase DEH	17.199,844
Clase DU	618,597
Clase IU	204.471,000
Clase ZU	58,000
Clase 1E	15.045.219,512
Clase 1U	990.421,390
Clase 2E	52,000
Clase 2U	2.085,189
Clase 8E	275.565,070
Clase 8U	205.092,721

## ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AEH	15,4364 <sup>1</sup>	15,0223 <sup>1</sup>	10,3913 <sup>1</sup>
Clase AU	16,1949	15,6740	10,7050
Clase DEH	15,3556 <sup>1</sup>	14,9762 <sup>1</sup>	10,4242 <sup>1</sup>
Clase DU	16,0662	15,5884	10,6942
Clase IU	16,7576	16,1456	10,9288
Clase ZU	16,5903	15,9900	10,8327
Clase 1E	5,2643 <sup>1</sup>	5,0213 <sup>1</sup>	3,6694 <sup>1</sup>
Clase 1U	6,1104	5,9106	4,0324
Clase 2E	16,3588 <sup>1</sup>	15,5305 <sup>1</sup>	11,2523 <sup>1</sup>
Clase 2U	16,6441	16,0307	10,8434
Clase 8E	5,8217 <sup>1</sup>	5,5302 <sup>1</sup>	4,0084 <sup>1</sup>
Clase 8U	6,8327	6,5821	4,4540

<sup>1</sup> 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 2021

	Notas	2021 USD
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>209.555.266</b>
<b>Ingresos</b>		
Dividendos, neto	2	508.351
Interés bancario	2	906
Ingresos por intereses en swaps		37.669
<b>Total de ingresos</b>		<b>546.926</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.023.248)
Interés bancario	2	(553)
Dividendos pagados en swaps		(168.138)
Gastos por intereses en swaps		(255.857)
Impuestos extranjeros	3	(54.131)
Gastos operativos	3, 5	(132.204)
<b>Total de gastos</b>		<b>(1.634.131)</b>
<b>(Pérdida) neta de inversiones</b>		<b>(1.087.205)</b>
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		35.395.462
Ganancia neta realizada en swaps		5.176.954
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(48.115)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		27.664
<b>Ganancia neta realizada</b>		<b>40.551.965</b>
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(27.780.184)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en swaps		(2.491.858)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(16.940)
<b>Cambio neto en (pérdida) no realizada</b>		<b>(30.288.982)</b>
<b>Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>9.175.778</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		5.539.254
Reembolsos de acciones		(116.569.895)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>(111.030.641)</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>107.700.403</b>

## VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	107.700.403	209.555.266	163.281.752

## Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

### ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 USD
<b>Activos</b>		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	390.025.337
Efectivo en el banco	2	17.614.739
Suscripciones por cobrar		2.591.087
Interés y dividendos por cobrar, neto		274
Ganancia neta no realizada en swaps	2, 10	1.628.036
<b>Total de activos</b>		<b>411.859.473</b>
<b>Pasivos</b>		
Reembolsos pagaderos		(4.295.968)
Interés pagadero en swaps	2	(30.157)
Pago por adelantado cobrado en swaps	2	(51)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(2.740.648)
(Pérdida) neta no realizada en contratos de futuros	2, 11	(43.750)
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(113.680)
Otros pasivos	20	(61.165)
<b>Total de pasivos</b>		<b>(7.285.419)</b>
<b>Total de patrimonio neto</b>		<b>404.574.054</b>

### NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	263.682,000
Clase AFH	205.730,729
Clase AGH	71.685,256
Clase ASH	501.433,376
Clase AU	724.688,185
Clase DEH	172.540,023
Clase DU	485.470,581
Clase IEH	555.761,917
Clase IG	64,000
Clase IGH	3.911.422,442
Clase IU	986.577,260
Clase NG	181.438,010
Clase XU	14.326.140,998
Clase ZEH	4.712,311
Clase ZFH	160,000
Clase ZGH	168.726,797
Clase ZU	7.910,286

### ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

durante el ejercicio contable del 1 de abril al 30 de septiembre de 2021

	Notas	2021 USD
<b>Patrimonio neto al inicio del periodo</b>		<b>528.893.598</b>
<b>Ingresos</b>		
Interés sobre bonos, neto	2	103.317
Interés bancario	2	3.100
Ingresos por intereses en swaps		17.069
<b>Total de ingresos</b>		<b>123.486</b>
<b>Gastos</b>		
Comisiones de gestión de activos	5	(951.193)
Interés bancario	2	(1.590)
Gastos por intereses en swaps		(461.571)
Gastos por intereses en contratos de futuros		(55)
Gastos operativos	3, 5	(450.101)
<b>Total de gastos</b>		<b>(1.864.510)</b>
<b>(Pérdida) neta de inversiones</b>		<b>(1.741.024)</b>
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		173.847
Ganancia neta realizada en swaps		80.314.518
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(126.652)
(Pérdida) neta realizada en contratos de futuros		(1.180)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(261.167)
<b>Ganancia neta realizada</b>		<b>80.099.366</b>
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(131.602)
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		15.513.109
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo		(2.349.487)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de futuros		(43.750)
<b>Cambio neto en ganancia no realizada</b>		<b>12.988.270</b>
<b>Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones</b>		<b>91.346.612</b>
<b>Movimientos de capital</b>		
Suscripciones de acciones		73.601.161
Reembolsos de acciones		(289.267.317)
<b>Total de movimientos de capital</b>		<b>(215.666.156)</b>
<b>Patrimonio neto al final del periodo</b>		<b>404.574.054</b>

### VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
USD	404.574.054	528.893.598	292.751.295

**Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities****ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN**

	30 de septiembre de 2021	31 de marzo de 2021	31 de marzo de 2020
Clase AEH	10,0173 <sup>1</sup>	8,4906 <sup>1</sup>	6,3865 <sup>1</sup>
Clase AFH	7,3942 <sup>2</sup>	6,2739 <sup>2</sup>	4,7274 <sup>2</sup>
Clase AGH	10,7520 <sup>3</sup>	9,0951 <sup>3</sup>	6,8077 <sup>3</sup>
Clase ASH	5,6496 <sup>4</sup>	4,7702 <sup>4</sup>	3,5575 <sup>4</sup>
Clase AU	11,8783	10,0129	7,4279
Clase DEH	7,5856 <sup>1</sup>	6,4457 <sup>1</sup>	4,8729 <sup>1</sup>
Clase DU	8,9980	7,6039	5,6690
Clase IEH	14,8139 <sup>1</sup>	12,4903 <sup>1</sup>	9,2968 <sup>1</sup>
Clase IG	12,2585 <sup>3</sup>	10,0476 <sup>3</sup>	8,2193 <sup>3</sup>
Clase IGH	15,8641 <sup>3</sup>	13,3493 <sup>3</sup>	9,8874 <sup>3</sup>
Clase IU	17,5453	14,7124	10,8005
Clase NG	11,8252 <sup>3</sup>	9,6735 <sup>3</sup>	7,8743 <sup>3</sup>
Clase XU	18,6158	15,5436	11,3145
Clase ZEH	6,2550 <sup>1</sup>	5,2751 <sup>1</sup>	3,9285 <sup>1</sup>
Clase ZFH	6,0487 <sup>2</sup>	5,1075 <sup>2</sup>	3,8109 <sup>2</sup>
Clase ZGH	9,0796 <sup>3</sup>	7,6437 <sup>3</sup>	5,6644 <sup>3</sup>
Clase ZU	7,2348	6,0682	4,4569

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

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

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

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

## Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

### Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2021

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Bonos</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>AUSTRALIA</b>				<b>ISLAS CAIMÁN (continuación)</b>					
EUR	2.106.000	APT Pipelines Limited 1.25% 15/03/2033	2.427.874	0,44	GBP	1.060.000	Southern Water Services Finance Limited 3.00% 28/05/2037	1.533.746	0,28
EUR	2.170.000	Aurizon Network Pty Limited 3.13% 01/06/2026	2.843.952	0,52	USD	2.430.000	Tencent Holdings Limited 3.60% 19/01/2028	2.603.866	0,48
USD	1.508.000	Ausgrid Finance Pty Limited 4.35% 01/08/2028	1.695.091	0,31	USD	1.000.000	Tencent Holdings Limited 3.93% 19/01/2038	1.061.179	0,19
USD	2.515.000	Australia & New Zealand Banking Group Limited FRN 25/11/2035	2.436.877	0,44	<b>Total de Islas Caimán</b>			<b>14.713.247</b>	<b>2,68</b>
EUR	844.000	Goodman Australia 1.38% 27/09/2025	1.022.415	0,19	<b>DINAMARCA</b>				
USD	2.215.000	SGSP Australia Assets Pty 3.50% 07/07/2027	2.418.095	0,44	EUR	836.000	Danske Bank AS FRN 15/05/2031	973.524	0,18
USD	1.835.000	Westpac Banking Corp. FRN 15/11/2035	1.797.355	0,33	EUR	1.727.000	Nykredit Realkredit AS 0.38% 17/01/2028	1.976.711	0,36
<b>Total de Australia</b>			<b>14.641.659</b>	<b>2,67</b>	<b>Total de Dinamarca</b>			<b>2.950.235</b>	<b>0,54</b>
<b>BÉLGICA</b>				<b>FINLANDIA</b>					
EUR	835.000	Anheuser-Busch InBev SA/ NV 3.70% 02/04/2040	1.299.108	0,24	EUR	946.000	Nordea Bank Abp 0.50% 14/05/2027	1.123.923	0,20
EUR	250.000	Anheuser-Busch InBev SA/ NV 3.70% 02/04/2040	388.955	0,07	EUR	4.295.000	OP Corporate Bank plc 0.10% 16/11/2027	4.951.210	0,91
<b>Total de Bélgica</b>			<b>1.688.063</b>	<b>0,31</b>	<b>Total de Finlandia</b>			<b>6.075.133</b>	<b>1,11</b>
<b>BERMUDAS</b>				<b>FRANCIA</b>					
USD	1.922.000	Bacardi Limited 5.30% 15/05/2048	2.503.730	0,46	EUR	2.900.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.25% 29/06/2028	3.353.111	0,61
<b>Total de Bermudas</b>			<b>2.503.730</b>	<b>0,46</b>	EUR	600.000	BPCE SA 0.25% 14/01/2031	674.450	0,12
<b>CANADÁ</b>				<b>FRANCIA (continuación)</b>					
USD	1.580.000	Enbridge Inc. 2.50% 01/08/2033	1.589.453	0,29	EUR	1.700.000	Credit Agricole SA 0.50% 21/09/2029	1.956.135	0,36
USD	450.000	Rogers Communications Inc. 3.70% 15/11/2049	464.939	0,08	EUR	400.000	Electricite de France SA 2.00% 09/12/2049	492.652	0,09
<b>Total de Canadá</b>			<b>2.054.392</b>	<b>0,37</b>	EUR	2.200.000	Electricite de France SA Perp FRN	2.592.297	0,47
<b>ISLAS CAIMÁN</b>				<b>FRANCIA (continuación)</b>					
USD	732.000	Alibaba Group Holding Limited 4.00% 06/12/2037	796.793	0,15	EUR	2.035.000	Faurecia 2.38% 15/06/2029	2.387.730	0,43
GBP	3.580.000	Southern Water Services Finance Limited 1.63% 30/03/2027	4.805.596	0,87	EUR	900.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 0.63% 08/07/2032	1.043.802	0,19
GBP	2.804.000	Southern Water Services Finance Limited 2.38% 28/05/2028	3.912.067	0,71	EUR	1.000.000	Sanef SA 1.88% 16/03/2026	1.241.389	0,23
<b>Total de Islas Caimán</b>			<b>14.641.659</b>	<b>2,67</b>	<b>Total de Francia</b>			<b>13.741.566</b>	<b>2,50</b>
<b>ALEMANIA</b>				<b>ALEMANIA (continuación)</b>					
EUR	800.000	Adler Real Estate AG 3.00% 27/04/2026	816.417	0,15	EUR	1.000.000	alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	1.168.012	0,21

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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>ALEMANIA (continuación)</b>				<b>ITALIA</b>					
EUR	3.400.000	Amprion GmbH 0.63% 23/09/2033	3.854.135	0,70	EUR	908.000	Aeroporti di Roma SpA 1.63% 08/06/2027	1.103.417	0,20
EUR	1.175.000	Commerzbank AG 0.50% 04/12/2026	1.382.082	0,25	EUR	427.000	Aeroporti di Roma SpA 1.63% 02/02/2029	518.899	0,09
EUR	1.000.000	Commerzbank AG 1.38% 29/12/2031	1.147.711	0,21	EUR	598.000	Aeroporti di Roma SpA 1.75% 30/07/2031	719.758	0,13
EUR	3.200.000	Commerzbank AG FRN 05/12/2030	4.096.536	0,76	EUR	801.000	Autostrade per l'Italia 2.00% 04/12/2028	977.038	0,18
EUR	2.198.000	Deutsche Bank AG FRN 10/06/2026	2.672.572	0,49	EUR	950.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.88% 26/09/2029	1.151.473	0,21
EUR	900.000	Deutsche Bank AG FRN 19/11/2030	1.099.300	0,20	EUR	1.386.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1.88% 09/01/2026	1.616.824	0,29
USD	1.610.000	Deutsche Bank AG FRN 28/05/2032	1.636.903	0,30	EUR	358.000	Eni SpA Perp FRN	421.415	0,08
EUR	349.000	Gruenthal GmbH 3.63% 15/11/2026	420.214	0,08	EUR	673.000	Eni SpA Perp FRN	833.252	0,15
EUR	1.400.000	Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	1.600.647	0,29	EUR	1.096.000	Nexi SpA 1.63% 30/04/2026	1.276.516	0,24
EUR	491.000	Volkswagen Financial Services AG 3.38% 06/04/2028	670.312	0,12			<b>Total de Italia</b>	<b>8.618.592</b>	<b>1,57</b>
EUR	600.000	Vonovia SE 0.63% 14/12/2029	695.125	0,13	<b>JERSEY - ISLAS DEL CANAL</b>				
EUR	700.000	Vonovia SE 1.50% 14/06/2041	803.734	0,15	USD	1.447.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.63% 31/03/2036	1.425.012	0,26
		<b>Total de Alemania</b>	<b>22.063.700</b>	<b>4,04</b>	USD	2.406.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.94% 30/09/2040	2.404.978	0,44
<b>INDIA</b>					EUR	1.176.000	Heathrow Funding Limited 1.13% 08/10/2030	1.356.530	0,25
USD	1.830.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029	1.915.370	0,34	EUR	300.000	Heathrow Funding Limited 1.88% 14/03/2034	363.633	0,07
USD	1.180.000	GMR Hyderabad International Airport Limited 4.25% 27/10/2027	1.133.455	0,21			<b>Total de Jersey - Islas del Canal</b>	<b>5.550.153</b>	<b>1,02</b>
USD	310.000	GMR Hyderabad International Airport Limited 5.38% 10/04/2024	317.737	0,06	<b>LUXEMBURGO</b>				
		<b>Total de India</b>	<b>3.366.562</b>	<b>0,61</b>	EUR	1.600.000	Aroundtown SA 0.00% 16/07/2026	1.824.921	0,33
<b>IRLANDA</b>					EUR	1.000.000	Aroundtown SA 1.45% 09/07/2028	1.212.717	0,22
EUR	2.330.000	AIB Group plc FRN 19/11/2029	2.785.949	0,51	GBP	400.000	Aroundtown SA 3.00% 16/10/2029	573.329	0,10
EUR	900.000	AIB Group plc FRN 30/05/2031	1.120.642	0,20	USD	1.831.000	Aroundtown SA 5.38% 21/03/2029	2.150.280	0,39
EUR	1.482.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	1.719.167	0,31	EUR	2.335.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 04/06/2026	2.825.190	0,52
EUR	3.636.000	Eaton Capital Unlimi 0.58% 08/03/2030	4.216.284	0,77	EUR	1.154.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 12/02/2036	1.323.037	0,24
USD	2.675.000	GE Capital International Funding Company 4.42% 15/11/2035	3.212.638	0,58	EUR	1.979.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.34% 13/08/2041	2.210.466	0,40
		<b>Total de Irlanda</b>	<b>13.054.680</b>	<b>2,37</b>	EUR	1.754.000	Medtronic Global Holdings SCA 1.38% 15/10/2040	2.065.320	0,37
					EUR	1.901.000	Nestle Finance International Limited 0.63% 14/02/2034	2.195.706	0,40

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			
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>						
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>						
<b>LUXEMBURGO (continuación)</b>				<b>ESPAÑA (continuación)</b>						
EUR	2.066.000	Novartis Finance SA 0.00% 23/09/2028	2.361.666	0,43	EUR	309.000	Nortegas Energia Distribucion SAU 2.07% 28/09/2027	386.943	0,07	
<b>Total de Luxemburgo</b>			<b>18.742.632</b>	<b>3,40</b>	<b>Total de España</b>			<b>2.031.338</b>	<b>0,37</b>	
<b>MÉXICO</b>				<b>SUECIA</b>						
EUR	700.000	Petroleos Mexicanos 4.75% 26/02/2029	805.998	0,15	EUR	3.244.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	3.864.117	0,70	
<b>Total de México</b>			<b>805.998</b>	<b>0,15</b>	EUR	573.000	Sagax AB 2.00% 17/01/2024	691.350	0,13	
<b>Total de México</b>			<b>805.998</b>	<b>0,15</b>	<b>Total de Suecia</b>			<b>4.555.467</b>	<b>0,83</b>	
<b>PAÍSES BAJOS</b>				<b>SUIZA</b>						
EUR	302.000	Airbus SE 2.38% 09/06/2040	400.641	0,07	EUR	1.714.000	Credit Suisse AG 0.25% 01/09/2028	1.941.967	0,35	
EUR	746.000	Akelius Residential Property Financing BV 0.75% 22/02/2030	848.184	0,15	EUR	2.350.000	Credit Suisse Group AG 0.63% 18/01/2033	2.568.572	0,47	
EUR	1.036.000	Akelius Residential Property Financing BV 1.13% 11/01/2029	1.223.935	0,22	USD	759.000	Credit Suisse Group AG FRN 14/05/2032	776.463	0,14	
EUR	2.000.000	Cooperatieve Rabobank UA 1.38% 03/02/2027	2.494.155	0,45	USD	1.000.000	Credit Suisse Group AG FRN 01/04/2031	1.118.848	0,20	
EUR	382.000	Digital Dutch Finco BV 1.50% 15/03/2030	465.367	0,08	USD	330.000	Credit Suisse Group AG Perp FRN	361.166	0,07	
GBP	2.114.000	E.ON International Finance BV 6.25% 03/06/2030	3.797.292	0,68	EUR	2.497.000	UBS AG 0.50% 31/03/2031	2.869.126	0,52	
EUR	1.127.000	Enexis Holding NV 0.75% 02/07/2031	1.351.687	0,25	USD	623.000	UBS AG 5.13% 15/05/2024	682.670	0,12	
EUR	1.300.000	Iberdrola International BV Perp FRN	1.514.905	0,28	USD	530.000	UBS Group AG Perp FRN	576.574	0,11	
EUR	1.500.000	ING Groep NV 0.38% 29/09/2028	1.721.477	0,31	USD	900.000	UBS Group AG Perp FRN	1.026.947	0,19	
EUR	1.107.000	Royal Schiphol Group NV 0.75% 22/04/2033	1.271.049	0,23	USD	768.000	UBS Group Funding Switzerland AG Perp FRN	837.965	0,15	
GBP	820.000	Shell International Finance BV 1.75% 10/09/2052	918.672	0,17	<b>Total de Suiza</b>			<b>12.760.298</b>	<b>2,32</b>	
EUR	2.300.000	Stedin Holding NV Perp FRN	2.715.951	0,49	<b>REINO UNIDO</b>					
EUR	1.000.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	1.130.695	0,21	USD	767.000	Anglo American Capital plc 3.95% 10/09/2050	819.342	0,15	
EUR	500.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	629.754	0,11	USD	1.549.000	Bae Systems plc 3.40% 15/04/2030	1.669.818	0,30	
EUR	3.883.000	Tennet Holding BV Perp FRN	4.724.339	0,85	EUR	815.000	Barclays plc FRN 12/05/2032	951.489	0,17	
EUR	1.600.000	Volkswagen International Finance NV 4.13% 16/11/2038	2.565.101	0,47	EUR	1.100.000	Barclays plc FRN 12/05/2032	1.284.219	0,23	
<b>Total de Paises Bajos</b>			<b>27.773.204</b>	<b>5,02</b>	GBP	1.680.000	BAT International Finance plc 2.25% 26/06/2028	2.243.107	0,40	
<b>NORUEGA</b>				<b>REINO UNIDO</b>						
EUR	1.125.000	Dnb Bank ASA 0.25% 09/04/2024	1.322.520	0,24	USD	2.665.000	Bp Capital Markets plc Perp FRN	2.844.741	0,52	
<b>Total de Noruega</b>			<b>1.322.520</b>	<b>0,24</b>	EUR	2.459.000	British American Tobacco plc Perp 3.00%	2.828.710	0,52	
<b>ESPAÑA</b>				<b>REINO UNIDO</b>						
EUR	1.400.000	Caixabank SA 0.38% 03/02/2025	1.644.395	0,30	GBP	750.000	Broadgate Financing plc 5.00% 05/10/2031	1.159.318	0,21	
						GBP	483.284	Broadgate Financing plc 5.10% 05/04/2033	768.239	0,14
						EUR	2.591.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	3.003.287	0,55

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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>REINO UNIDO (continuación)</b>				<b>REINO UNIDO (continuación)</b>					
EUR	507.000	Cadent Finance plc 0.75% 11/03/2032	582.723	0,11	GBP	1.121.000	Telereal Securitisation plc FRN 10/12/2033	1.527.564	0,28
GBP	2.216.000	Ds Smith plc 2.88% 26/07/2029	3.119.186	0,57	GBP	425.488	Tesco Property Finance 7.62% 13/07/2039	836.639	0,15
GBP	614.821	Eversholt Funding plc 2.74% 30/06/2040	858.949	0,16	GBP	828.453	Tesco Property Finance 3 plc 5.74% 13/04/2040	1.465.954	0,27
GBP	385.000	Eversholt Funding plc 3.53% 07/08/2042	576.308	0,10	GBP	1.214.899	Tesco Property Finance 5 plc 5.66% 13/10/2041	2.147.689	0,38
GBP	425.000	GKN Holdings plc 5.38% 19/09/2022	595.421	0,11	GBP	492.953	Tesco Property Finance 6 plc 5.41% 13/07/2044	852.126	0,16
EUR	424.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	559.122	0,10	GBP	1.120.000	Thames Water Kemble Finance plc 4.63% 19/05/2026	1.579.697	0,29
EUR	28.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	36.923	0,01	GBP	1.010.000	Virgin Money UK plc FRN 19/08/2031	1.371.620	0,25
GBP	1.004.000	HSBC Bank plc 5.38% 22/08/2033	1.764.058	0,32	GBP	1.010.000	Virgin Money UK plc FRN 19/08/2031	1.371.620	0,25
GBP	950.000	HSBC Holdings plc FRN 24/07/2027	1.279.483	0,23	EUR	1.463.000	Vodafone Group plc FRN 27/08/2080	1.757.304	0,32
USD	850.000	Imperial Brands Finance plc 3.50% 26/07/2026	910.347	0,17	GBP	720.000	Western Power Distribution plc 3.50% 16/10/2026	1.061.943	0,19
GBP	453.000	Imperial Brands Finance plc 5.50% 28/09/2026	713.433	0,13			<b>Total del Reino Unido</b>	<b>65.446.916</b>	<b>11,91</b>
EUR	773.000	International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	920.736	0,17	<b>ESTADOS UNIDOS</b>				
GBP	278.000	Legal & General Group plc FRN 01/11/2050	421.500	0,08	USD	2.982.000	AbbVie Inc. 4.25% 21/11/2049	3.523.679	0,63
GBP	520.000	Legal & General Group plc FRN 27/06/2064	880.594	0,16	USD	967.000	AbbVie Inc. 4.88% 14/11/2048	1.240.582	0,23
GBP	2.070.000	Lloyds TSB Bank plc 7.63% 22/04/2025	3.406.362	0,62	USD	875.000	AEP Texas Inc. 3.45% 15/05/2051	909.937	0,17
GBP	475.000	M&G plc FRN 19/12/2063	822.891	0,15	USD	3.380.000	Amazon.com Inc. 3.10% 12/05/2051	3.559.683	0,65
EUR	867.000	Motability Operations Group plc 0.13% 20/07/2028	996.456	0,18	EUR	1.511.000	American Tower Corp. 0.95% 05/10/2030	1.744.647	0,32
EUR	780.000	National Grid Electricity Transmission plc 0.82% 07/07/2032	912.517	0,17	USD	1.805.000	Amgen Inc. 3.15% 21/02/2040	1.844.729	0,34
EUR	1.626.000	National Grid Electricity Transmission plc 0.82% 07/07/2032	1.902.248	0,35	USD	2.012.000	Anheuser-Busch Companies LLC 4.70% 01/02/2036	2.433.641	0,44
EUR	3.500.000	Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	4.024.608	0,72	USD	700.000	Anheuser-Busch Companies LLC 4.90% 01/02/2046	870.183	0,16
EUR	1.758.000	Natwest Group plc FRN 26/02/2030	2.037.364	0,37	USD	2.274.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc. 5.45% 23/01/2039	2.945.352	0,53
USD	1.255.000	NatWest Group plc FRN 08/05/2030	1.436.403	0,26	USD	1.306.000	Apple Inc. 2.65% 11/05/2050	1.260.532	0,23
GBP	458.000	Natwest Group plc Perp FRN	664.017	0,12	EUR	854.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 2.00% 01/09/2028	999.839	0,18
EUR	2.505.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	2.960.943	0,54	USD	1.357.000	Astrazeneca Finance LLC 2.25% 28/05/2031	1.380.609	0,25
GBP	683.000	Phoenix Group Holdings plc 5.63% 28/04/2031	1.104.528	0,20	USD	933.000	AT&T Inc. 3.10% 01/02/2043	896.394	0,16
GBP	270.000	Santander UK plc Perp 10.06%	649.382	0,12	USD	535.000	AT&T Inc. 3.50% 01/06/2041	549.652	0,10
EUR	921.000	SSE plc Perp FRN	1.137.608	0,21	USD	4.127.000	AT&T Inc. 3.50% 15/09/2053	4.089.547	0,74
					CAD	1.500.000	AT&T Inc. 4.00% 25/11/2025	1.286.060	0,23
					USD	1.997.000	AT&T Inc. 4.90% 15/08/2037	2.432.660	0,45

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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>				<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>					
USD	1.350.000	Bank of America Corp. FRN 21/07/2032	1.331.011	0,24	USD	1.551.000	Enterprise Products Operating LLC 4.45% 15/02/2043	1.787.629	0,33
USD	2.417.000	Bank of America Corp. FRN 13/02/2031	2.446.891	0,45	USD	3.515.000	Eversource Energy 2.55% 15/03/2031	3.585.525	0,65
USD	1.933.000	Bank of America Corp. FRN 29/04/2031	1.973.055	0,36	USD	1.597.000	Eversource Energy 3.45% 15/01/2050	1.681.410	0,31
USD	6.226.000	Bank of America Corp. FRN 11/03/2032	6.342.118	1,17	USD	580.000	Eversource Energy 3.45% 15/01/2050	610.656	0,11
USD	475.000	Bank of America Corp. FRN 24/10/2051	457.431	0,08	USD	335.000	Fedex Corp. 4.95% 17/10/2048	424.415	0,08
USD	1.238.000	Bank of America Corp. FRN 23/07/2030	1.318.723	0,24	EUR	917.000	Fidelity National Information Services Inc. 1.50% 21/05/2027	1.127.628	0,21
USD	1.500.000	Bayer US Finance II LLC 4.63% 25/06/2038	1.767.899	0,32	EUR	700.000	Fidelity National Information Services Inc. 1.50% 21/05/2027	860.785	0,16
EUR	1.652.000	Becton Dickinson and Company 1.90% 15/12/2026	2.071.269	0,38	EUR	868.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.00% 21/05/2030	1.111.803	0,20
USD	1.349.000	Becton Dickinson and Company 4.69% 15/12/2044	1.678.443	0,31	EUR	454.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.95% 21/05/2039	639.237	0,12
USD	844.000	Berkshire Hathaway Finance Corp 4.25% 15/01/2049	1.037.235	0,19	EUR	500.000	Fiserv Inc. 1.13% 01/07/2027	605.541	0,11
USD	2.011.000	Boeing Company 3.95% 01/08/2059	2.053.671	0,38	EUR	1.015.000	Fiserv Inc. 1.63% 01/07/2030	1.262.959	0,23
USD	750.000	Boeing Company 5.93% 01/05/2060	1.026.243	0,19	EUR	310.000	General Electric Company 4.13% 19/09/2035	486.193	0,09
USD	1.002.000	Broadcom Inc. 4.15% 15/11/2030	1.110.335	0,20	GBP	1.165.000	General Electric Company 5.38% 18/12/2040	2.191.995	0,40
USD	630.000	Broadcom Inc. 5.00% 15/04/2030	736.801	0,13	EUR	1.548.000	General Motors Financial Company Inc. 0.60% 20/05/2027	1.790.828	0,33
USD	2.376.000	Charter Communications Operating LLC 3.95% 30/06/2062	2.299.404	0,42	USD	491.000	Georgia Power Company 3.70% 30/01/2050	529.277	0,10
USD	757.000	Cigna Corp. 4.90% 15/12/2048	966.699	0,18	USD	489.000	Goodman USA Finance Three LLC 3.70% 15/03/2028	530.162	0,10
EUR	1.012.000	Citigroup Inc. FRN 06/07/2026	1.221.805	0,22	USD	1.000.000	Intel Corp. 3.05% 12/08/2051	994.164	0,18
USD	3.020.000	Citigroup Inc. FRN 31/03/2031	3.483.411	0,63	USD	849.000	Intel Corp. 4.75% 25/03/2050	1.111.955	0,21
USD	250.000	Conagra Brands Inc. 5.40% 01/11/2048	334.944	0,06	EUR	1.119.000	Iqvia Inc. 1.75% 15/03/2026	1.316.570	0,24
USD	303.000	Consolidated Edison Co of NY 3.95% 01/04/2050	345.724	0,06	EUR	400.000	Iqvia Inc. 2.25% 15/01/2028	467.537	0,09
USD	150.000	CSX Corp. 3.80% 01/11/2046	168.591	0,03	EUR	330.000	Iqvia Inc. 2.88% 15/09/2025	385.725	0,07
USD	726.000	CSX Corp. 3.80% 15/04/2050	825.624	0,15	USD	1.710.000	JPMorgan Chase & Company FRN 04/02/2032	1.651.375	0,30
USD	870.000	CVS Health Corp. 2.70% 21/08/2040	833.991	0,15	USD	3.899.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2032	3.953.805	0,73
USD	721.000	CVS Health Corp. 5.05% 25/03/2048	930.251	0,17	USD	2.352.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2041	2.431.758	0,44
EUR	2.184.000	Digital Euro Finco LLC 2.50% 16/01/2026	2.765.165	0,51	USD	1.557.000	JPMorgan Chase & Company FRN 24/07/2038	1.775.789	0,32
USD	925.000	Duke Energy Progress Inc. 4.20% 15/08/2045	1.102.599	0,20	USD	1.120.000	Kimco Realty Corp. 2.25% 01/12/2031	1.096.190	0,20
EUR	995.000	Eli Lilly & Company 1.38% 14/09/2061	1.084.073	0,20	USD	1.591.000	Kinder Morgan Energy Partners LP 5.00% 01/03/2043	1.884.407	0,34
USD	760.000	Emera USA Finance LP 4.75% 15/06/2046	897.444	0,16	GBP	2.397.000	Kraft Heinz Foods Company 4.13% 01/07/2027	3.605.690	0,66
					USD	1.175.000	Kraft Heinz Foods Company 4.38% 01/06/2046	1.340.969	0,24

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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)</b>					
<b>Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>SUPRANACIONAL (continuación)</b>				<b>FRANCIA</b>					
USD	5.465.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.75% 11/03/2025	5.479.947	1,00	USD	1.384.000	BNP Paribas SA 2.16% 15/09/2029	1.373.927	0,25
					USD	1.516.000	BPCE SA 2.70% 01/10/2029	1.573.822	0,29
		<b>Total de supranacional</b>	<b>25.256.325</b>	<b>4,60</b>			<b>Total de Francia</b>	<b>2.947.749</b>	<b>0,54</b>
<b>REINO UNIDO</b>				<b>ITALIA</b>					
GBP	630.000	United Kingdom Gilt 0.63% 31/07/2035	781.708	0,14	USD	300.000	Intesa Sanpaolo SpA 4.00% 23/09/2029	328.377	0,06
GBP	1.179.000	United Kingdom Gilt 1.25% 22/10/2041	1.554.731	0,28			<b>Total de Italia</b>	<b>328.377</b>	<b>0,06</b>
GBP	712.000	United Kingdom Gilt 1.75% 22/01/2049	1.038.238	0,19	<b>PAÍSES BAJOS</b>				
		<b>Total del Reino Unido</b>	<b>3.374.677</b>	<b>0,610</b>	USD	249.000	E.ON International Finance BV 6.65% 30/04/2038	363.091	0,07
<b>ESTADOS UNIDOS</b>				<b>NORUEGA</b>					
USD	4.000.000	United States Treasury N/B 0.38% 15/07/2024	3.989.688	0,73	USD	2.117.000	DNB Bank ASA 1.13% 16/09/2026	2.095.272	0,38
USD	9.600.000	United States Treasury N/B 0.38% 30/09/2027	9.160.500	1,66			<b>Total de Noruega</b>	<b>2.095.272</b>	<b>0,38</b>
USD	16.093.000	United States Treasury N/B 0.63% 15/08/2030	14.969.003	2,72	<b>ESTADOS UNIDOS</b>				
USD	3.700.000	United States Treasury N/B 1.13% 15/08/2040	3.183.734	0,58	USD	1.701.000	Atlantic City Electric 2.30% 15/03/2031	1.718.933	0,31
USD	5.220.000	United States Treasury N/B 1.25% 15/05/2050	4.272.243	0,78	USD	3.463.000	Carrier Global Corp. 2.72% 15/02/2030	3.582.362	0,65
		<b>Total de Estados Unidos</b>	<b>35.575.168</b>	<b>6,47</b>	USD	343.000	Commonwealth Edison Company 4.00% 01/03/2049	407.596	0,07
<b>Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda</b>				<b>88.040.709 16,03</b>					
<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>492.436.067 89,70</b>					
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente</b>				<b>Bonos</b>					
<b>AUSTRALIA</b>				<b>ESTADOS UNIDOS</b>					
USD	1.347.000	APT Pipelines Limited 4.25% 15/07/2027	1.529.615	0,28	USD	568.000	Guardian Life Insurance Company of America 4.85% 24/01/2077	737.475	0,13
USD	4.378.000	Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	4.914.945	0,89	USD	1.912.000	Jersey Central Power & Light Company 2.75% 01/03/2032	1.959.845	0,36
		<b>Total de Australia</b>	<b>6.444.560</b>	<b>1,17</b>	USD	1.406.000	Metropolitan Edison Company 4.30% 15/01/2029	1.577.544	0,29
					USD	3.000.000	Metropolitan Life Global Funding I 1.55% 07/01/2031	2.854.709	0,52
					USD	493.000	New York Life Insurance Company 4.45% 04/04/2069	624.148	0,11
					USD	3.530.000	Northwestern Mutual Life Insurance Company 3.45% 30/03/2051	3.798.577	0,70

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			
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)</b>				<b>Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>						
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Fondos</b>						
<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>				<b>IRLANDA</b>						
USD	308.000	Northwestern Mutual Life Insurance Company 3.63% 30/09/2059	336.589	0,06	9.514.569	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	9.514.569	1,73		
USD	394.000	Northwestern Mutual Life Insurance Company 3.85% 30/09/2047	448.835	0,08	<b>Total de Irlanda</b>			<b>9.514.569</b>	<b>1,73</b>	
USD	495.000	Peachtree Fund Trust 3.98% 15/02/2025	537.646	0,10	<b>Total de fondos</b>			<b>9.514.569</b>	<b>1,73</b>	
USD	889.000	Teachers Insurance & Annuity Association America 4.90% 15/09/2044	1.152.577	0,21	<b>Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>				<b>9.514.569</b>	<b>1,73</b>
USD	2.267.000	Teachers Insurance & Annuity Association of America 4.27% 15/05/2047	2.743.870	0,50	<b>Valor total de las inversiones</b>				<b>542.513.205</b>	<b>98,81</b>
<b>Total de Estados Unidos</b>			<b>22.480.706</b>	<b>4,09</b>	<b>(Coste total: 535.129.538 USD)</b>					
<b>Total de bonos</b>			<b>35.101.492</b>	<b>6,39</b>						
<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente</b>			<b>35.101.492</b>	<b>6,39</b>						
<b>Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario</b>										
<b>Bonos</b>										
<b>CANADÁ</b>										
CAD	1.980.000	Rogers Communications Inc. 3.65% 31/03/2027	1.673.316	0,30						
<b>Total de Canadá</b>			<b>1.673.316</b>	<b>0,30</b>						
<b>DINAMARCA</b>										
USD	3.786.000	Danske Bank AS 1.55% 10/09/2027	3.762.264	0,69						
<b>Total de Dinamarca</b>			<b>3.762.264</b>	<b>0,69</b>						
<b>PORTUGAL</b>										
EUR	200.000	Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2022	25.497	0,00						
<b>Total de Portugal</b>			<b>25.497</b>	<b>0,00</b>						
<b>Total de bonos</b>			<b>5.461.077</b>	<b>0,99</b>						
<b>Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario</b>			<b>5.461.077</b>	<b>0,99</b>						

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			
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>						
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>						
<b>ALEMANIA (continuación)</b>				<b>ITALIA (continuación)</b>						
EUR	700.000	Commerzbank AG FRN 05/12/2030	773.215	0,61	EUR	420.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.75% 01/02/2027	435.028	0,34	
EUR	2.023.000	Deutsche Bank AG FRN 10/06/2026	2.122.428	1,67	EUR	392.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1.88% 09/01/2026	394.567	0,31	
EUR	500.000	Deutsche Bank AG FRN 19/11/2030	526.962	0,42	EUR	124.000	Eni SpA Perp FRN	125.946	0,10	
EUR	639.000	E.On SE 0.60% 01/10/2032	633.313	0,50	EUR	195.000	Eni SpA Perp FRN	208.320	0,16	
EUR	800.000	Eurogrid GmbH 0.74% 21/04/2033	800.566	0,63	EUR	394.000	Nexi SpA 1.63% 30/04/2026	395.956	0,31	
EUR	300.000	Eurogrid GmbH 0.74% 21/04/2033	300.212	0,24	EUR	309.000	Snam SpA 0.00% 15/08/2025	308.941	0,24	
EUR	700.000	Eurogrid GmbH 1.63% 03/11/2023	724.657	0,57	<b>Total de Italia</b>					
EUR	122.000	Gruenthal GmbH 3.63% 15/11/2026	126.748	0,10	<b>2.845.077</b>					
EUR	1.500.000	Hamburg Commercial Bank AG 0.38% 09/03/2026	1.503.536	1,18	<b>2,22</b>					
EUR	2.550.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.00% 30/06/2022	2.561.814	2,02	<b>JAPÓN</b>					
EUR	2.920.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2.50% 17/01/2022	2.946.472	2,32	EUR	900.000	Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0.01% 10/09/2025	904.408	0,71	
EUR	500.000	Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	493.256	0,39	<b>Total de Japón</b>					
EUR	115.000	Volkswagen Financial Services AG 3.38% 06/04/2028	135.466	0,11	<b>904.408</b>					
EUR	100.000	Volkswagen Financial Services AG 3.38% 06/04/2028	117.796	0,09	<b>0,71</b>					
EUR	300.000	Vonovia SE 0.63% 14/12/2029	299.894	0,24	<b>JERSEY - ISLAS DEL CANAL</b>					
EUR	300.000	Vonovia SE 1.50% 14/06/2041	297.215	0,23	EUR	315.000	Heathrow Funding Limited 1.13% 08/10/2030	313.522	0,25	
<b>Total de Alemania</b>				<b>19.089.035</b>	<b>15,05</b>	EUR	487.000	Heathrow Funding Limited 1.88% 14/03/2034	509.338	0,41
<b>IRLANDA</b>				<b>Total de Jersey - Islas del Canal</b>						
EUR	546.000	AIB Group plc FRN 19/11/2029	563.307	0,44	<b>822.860</b>					
EUR	370.000	AIB Group plc FRN 30/05/2031	397.522	0,31	<b>0,66</b>					
EUR	450.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	450.420	0,35	<b>LUXEMBURGO</b>					
EUR	1.049.000	Eaton Capital Unlimi 0.58% 08/03/2030	1.049.583	0,83	EUR	900.000	Aroundtown SA 1.45% 09/07/2028	941.754	0,74	
<b>Total de Irlanda</b>				<b>2.460.832</b>	<b>1,93</b>	EUR	400.000	Aroundtown SA 1.63% 31/01/2028	422.784	0,33
<b>ITALIA</b>				<b>Total de Luxemburgo</b>						
EUR	241.000	Aeroporti di Roma SpA 1.63% 08/06/2027	252.701	0,20	EUR	259.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 12/02/2036	256.213	0,20	
EUR	214.000	Aeroporti di Roma SpA 1.75% 30/07/2031	222.246	0,17	EUR	793.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.34% 13/08/2041	764.269	0,60	
EUR	283.000	Assicurazioni Generali SpA 5.00% 08/06/2048	344.552	0,27	EUR	924.000	Medtronic Global Holdings SCA 1.38% 15/10/2040	938.783	0,74	
EUR	149.000	Autostrade per l'Italia 2.00% 04/12/2028	156.820	0,12	EUR	770.000	Nestle Finance International Limited 0.63% 14/02/2034	767.394	0,60	
				<b>Total de México</b>						
				<b>298.052</b>	<b>0,23</b>	EUR	1.074.000	Novartis Finance SA 0.00% 23/09/2028	1.059.321	0,83
				<b>298.052</b>						
				<b>0,23</b>						
				<b>4,18</b>						
				<b>4,18</b>						
				<b>MÉXICO</b>						
				EUR 300.000 Petroleos Mexicanos 4.75% 26/02/2029						
				298.052						
				0,23						
				<b>298.052</b>						
				<b>0,23</b>						

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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>PAÍSES BAJOS</b>				<b>SUECIA</b>					
EUR	360.000	Airbus SE 2.38% 07/04/2032	415.071	0,33	EUR	1.071.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	1.100.765	0,86
EUR	200.000	Airbus SE 2.38% 09/06/2040	228.936	0,18			<b>Total de Suecia</b>	<b>1.100.765</b>	<b>0,86</b>
EUR	461.000	Akelius Residential Property Financing BV 0.75% 22/02/2030	452.259	0,36					
EUR	174.000	Akelius Residential Property Financing BV 1.13% 11/01/2029	177.371	0,14					
EUR	1.100.000	Allianz Finance II BV 0.25% 06/06/2023	1.111.642	0,87					
EUR	720.000	Cooperatieve Rabobank UA 1.38% 03/02/2027	774.750	0,61					
EUR	522.000	Digital Dutch Finco BV 1.50% 15/03/2030	548.704	0,43					
EUR	731.000	Enel Finance International NV 0.50% 17/06/2030	727.722	0,57					
EUR	482.000	Enexis Holding NV 0.63% 17/06/2032	489.256	0,39					
EUR	268.000	Enexis Holding NV 0.63% 17/06/2032	272.035	0,21					
EUR	790.000	Enexis Holding NV 0.75% 02/07/2031	817.551	0,64					
EUR	600.000	Iberdrola International BV Perp FRN	603.293	0,47					
EUR	300.000	ING Groep NV FRN 01/02/2030	291.423	0,23					
EUR	400.000	ING Groep NV 0.38% 29/09/2028	396.100	0,31					
EUR	1.695.000	Relx Finance BV 1.00% 22/03/2024	1.741.840	1,37					
EUR	415.000	Royal Schiphol Group NV 0.75% 22/04/2033	411.148	0,32					
EUR	345.000	Shell International Finance BV 1.88% 07/04/2032	386.179	0,30					
EUR	618.000	Stedin Holding NV 0.50% 14/11/2029	625.395	0,49					
EUR	863.000	Stedin Holding NV Perp FRN	879.306	0,69					
EUR	700.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	760.736	0,60					
EUR	475.000	Tennet Holding BV Perp FRN	498.658	0,39					
EUR	1.000.000	Volkswagen International Finance NV 4.13% 16/11/2038	1.383.310	1,09					
		<b>Total de Países Bajos</b>	<b>13.992.685</b>	<b>10,99</b>					
<b>NORUEGA</b>				<b>SUIZA</b>					
EUR	820.000	DNB Bank ASA FRN 23/02/2029	809.230	0,64	EUR	514.000	Credit Suisse AG 0.25% 01/09/2028	502.492	0,40
		<b>Total de Noruega</b>	<b>809.230</b>	<b>0,64</b>	EUR	1.136.000	Credit Suisse Group AG 0.63% 18/01/2033	1.071.365	0,84
					EUR	803.000	UBS AG 0.50% 31/03/2031	796.126	0,63
							<b>Total de Suiza</b>	<b>2.369.983</b>	<b>1,87</b>
<b>ESPAÑA</b>				<b>REINO UNIDO</b>					
EUR	1.200.000	Caixabank SA 0.38% 03/02/2025	1.216.171	0,96	EUR	893.000	AstraZeneca plc 0.38% 03/06/2029	893.478	0,70
		<b>Total de España</b>	<b>1.216.171</b>	<b>0,96</b>	EUR	336.000	Barclays plc FRN 12/05/2032	338.471	0,27
					EUR	281.000	Barclays plc FRN 12/05/2032	283.066	0,22
					EUR	614.000	BP Capital Markets plc Perp FRN	656.693	0,53
					EUR	515.000	British American Tobacco plc Perp 3.00%	511.178	0,40
					EUR	779.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	779.116	0,61
					EUR	252.000	Cadent Finance plc 0.75% 11/03/2032	249.914	0,20
					GBP	577.904	Delamare Finance plc 5.55% 19/02/2029	779.105	0,61
					EUR	380.000	Diageo Finance plc 0.13% 12/10/2023	383.069	0,30
					EUR	400.000	Diageo Finance plc 0.50% 19/06/2024	407.129	0,32
					EUR	432.000	DS Smith plc 0.88% 12/09/2026	442.255	0,35
					EUR	380.000	GlaxoSmithKline Capital plc 0.00% 23/09/2023	382.271	0,30
					EUR	735.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	836.302	0,66
					EUR	1.048.000	Imperial Brands Finance plc 3.38% 26/02/2026	1.175.317	0,93
					EUR	294.000	International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	302.161	0,24
					EUR	328.000	Motability Operations Group plc 0.13% 20/07/2028	325.273	0,26
					EUR	1.520.000	Motability Operations Group plc 1.63% 09/06/2023	1.571.082	1,24
					EUR	300.000	National Grid Electricity Transmission plc 0.82% 07/07/2032	302.833	0,24

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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>REINO UNIDO (continuación)</b>				<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>					
EUR	368.000	National Grid Electricity Transmission plc 0.82% 07/07/2032	371.475	0,29	EUR	606.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.00% 21/05/2030	669.755	0,53
EUR	1.000.000	Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	992.182	0,78	EUR	490.000	Fiserv Inc. 1.63% 01/07/2030	526.083	0,41
EUR	670.000	Natwest Group plc FRN 26/02/2030	669.977	0,53	EUR	873.000	General Electric Company 2.13% 17/05/2037	953.880	0,75
USD	1.050.000	NatWest Markets plc 1.60% 29/09/2026	905.699	0,71	EUR	585.000	General Motors Financial Company Inc. 0.60% 20/05/2027	583.948	0,46
EUR	1.020.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	1.040.298	0,83	EUR	529.000	Goldman Sachs Group Inc. 1.00% 18/03/2033	529.849	0,42
EUR	700.000	Thames Water Utilities Finance plc 0.19% 23/10/2023	702.818	0,55	EUR	427.000	lqvia Inc. 1.75% 15/03/2026	433.488	0,34
GBP	610.000	Virgin Money UK plc FRN 24/04/2026	751.628	0,59	EUR	706.000	JPMorgan Chase & Company FRN 17/02/2033	690.249	0,54
EUR	283.000	Vodafone Group plc FRN 27/08/2080	293.308	0,23	EUR	725.000	Kraft Heinz Foods Company 2.25% 25/05/2028	789.647	0,63
		<b>Total del Reino Unido</b>	<b>16.346.098</b>	<b>12,89</b>	EUR	340.000	Morgan Stanley FRN 07/02/2031	334.756	0,26
					EUR	680.000	Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	816.543	0,64
					EUR	281.000	Thermo Fisher Scientific Inc. 1.88% 01/10/2049	297.100	0,23
					EUR	468.000	Verizon Communications Inc. 0.88% 08/04/2027	484.497	0,38
					EUR	484.000	Verizon Communications Inc. 1.13% 19/09/2035	479.889	0,38
					USD	1.071.000	Verizon Communications Inc. 2.10% 22/03/2028	938.576	0,74
							<b>Total de Estados Unidos</b>	<b>16.844.964</b>	<b>13,25</b>
							<b>Total de bonos</b>	<b>109.796.930</b>	<b>86,40</b>
							<b>Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda</b>		
							<b>ALEMANIA</b>		
					EUR	2.290.000	Germany (Govt of) 0.00% 11/04/2025	2.344.067	1,84
					EUR	36.000	Germany (Govt of) 0.00% 15/08/2050	33.252	0,03
					EUR	1.440.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.05% 30/05/2024	1.463.107	1,15
							<b>Total de Alemania</b>	<b>3.840.426</b>	<b>3,02</b>
							<b>SUPRANACIONAL</b>		
					EUR	1.000.000	European Bank for Reconstruction & Development 0.00% 10/01/2024	1.011.064	0,80
					EUR	1.970.000	European Investment Bank 0.50% 15/11/2023	2.016.265	1,59

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				
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario</b>							
<b>Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)</b>				<b>Bonos</b>							
<b>SUPRANACIONAL (continuación)</b>				<b>DINAMARCA</b>							
EUR	1.390.000	IBRD 0.00% 15/01/2027	1.407.793	1,10	USD	509.000	Danske Bank AS 1.55% 10/09/2027	436.437	0,34		
<b>Total de supranacional</b>			<b>4.435.122</b>	<b>3,49</b>	<b>Total de Dinamarca</b>			<b>436.437</b>	<b>0,34</b>		
<b>Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda</b>				<b>8.275.548</b>	<b>6,51</b>	<b>FRANCIA</b>					
<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>118.072.478</b>	<b>92,91</b>	USD	930.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.60% 04/10/2026	804.117	0,63	
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente</b>						<b>Total de Francia</b>			<b>804.117</b>	<b>0,63</b>	
<b>Bonos</b>						<b>PORTUGAL</b>					
<b>FRANCIA</b>						EUR	600.000	Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2022	66.000	0,05	
USD	1.600.000	BPCE SA 2.70% 01/10/2029	1.433.216	1,13	<b>Total de Portugal</b>			<b>66.000</b>	<b>0,05</b>		
<b>Total de Francia</b>			<b>1.433.216</b>	<b>1,13</b>	<b>REINO UNIDO</b>						
<b>ITALIA</b>						EUR	350.000	Lehman Brothers UK Capital Funding III LP Perp 3.88%*	0	0,00	
USD	500.000	Intesa Sanpaolo SpA 4.00% 23/09/2029	472.233	0,37	<b>Total del Reino Unido</b>			<b>0</b>	<b>0,00</b>		
<b>Total de Italia</b>			<b>472.233</b>	<b>0,37</b>	<b>Total de bonos</b>				<b>1.306.554</b>	<b>1,02</b>	
<b>PAÍSES BAJOS</b>						<b>Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario</b>				<b>1.306.554</b>	<b>1,02</b>
USD	1.150.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	1.071.702	0,85	<b>Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>						
<b>Total de Países Bajos</b>			<b>1.071.702</b>	<b>0,85</b>	<b>Fondos</b>						
<b>NORUEGA</b>						<b>IRLANDA</b>					
USD	2.250.000	DNB Bank ASA 0.86% 30/09/2025	1.942.534	1,54	2.348	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier			231.461	0,18	
<b>Total de Noruega</b>			<b>1.942.534</b>	<b>1,54</b>	<b>Total de Irlanda</b>			<b>231.461</b>	<b>0,18</b>		
<b>Total de bonos</b>				<b>4.919.685</b>	<b>3,89</b>	<b>Total de fondos</b>				<b>231.461</b>	<b>0,18</b>
<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente</b>				<b>4.919.685</b>	<b>3,89</b>	<b>Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>				<b>231.461</b>	<b>0,18</b>
						<b>Valor total de las inversiones</b>				<b>124.530.178</b>	<b>98,00</b>
						<b>(Coste total: 121.995.063 EUR)</b>					
						<i>* Título a su valor razonable.</i>					



## 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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>FRANCIA (continuación)</b>				<b>ALEMANIA (continuación)</b>					
EUR	878.000	Laboratoire Eimer SE 5.00% 01/02/2029	908.749	0,17	EUR	1.100.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 11/02/2025	1.137.878	0,21
EUR	1.702.000	Loxam SAS 3.25% 14/01/2025	1.722.498	0,31	EUR	2.400.000	Deutsche Lufthansa AG 3.00% 29/05/2026	2.478.616	0,45
EUR	928.000	Loxam SAS 3.75% 15/07/2026	952.071	0,17	EUR	900.000	Deutsche Lufthansa AG 3.50% 14/07/2029	931.326	0,17
EUR	805.000	Loxam SAS 5.75% 15/07/2027	842.404	0,15	EUR	2.800.000	Deutsche Lufthansa AG 3.75% 11/02/2028	2.947.669	0,54
EUR	400.000	Orano SA 3.38% 23/04/2026	436.397	0,08	EUR	1.498.000	Douglas GmbH 6.00% 08/04/2026	1.523.417	0,28
EUR	350.000	Orano SA 4.88% 23/09/2024	395.598	0,07	EUR	824.000	Gruenthal GmbH 3.63% 15/11/2026	856.066	0,16
EUR	1.054.000	Paprec Holding SA 3.50% 01/07/2028	1.070.729	0,20	EUR	804.000	Gruenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	843.670	0,15
EUR	1.609.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	1.642.397	0,30	EUR	1.574.000	Gruenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	1.651.663	0,30
EUR	1.550.000	Parts Europe SA 6.50% 16/07/2025	1.619.860	0,29	EUR	2.322.000	HT Troplast AG 9.25% 15/07/2025	2.553.014	0,47
EUR	1.729.000	Picard Groupe SAS 3.88% 01/07/2026	1.759.682	0,32	EUR	548.360	IHO Verwaltungs GmbH 3.75% 15/09/2026	559.155	0,10
EUR	500.000	Renault SA 1.25% 24/06/2025	495.969	0,09	EUR	2.239.000	Ineos Styrolution Group GmbH 2.25% 16/01/2027	2.221.378	0,41
EUR	1.000.000	Renault SA 2.00% 28/09/2026	993.905	0,18	EUR	700.000	Infineon Technologies AG Perp FRN	734.470	0,13
EUR	2.200.000	Renault SA 2.38% 25/05/2026	2.228.071	0,41	EUR	700.000	Infineon Technologies AG Perp FRN	775.205	0,15
EUR	1.500.000	Renault SA 2.50% 01/04/2028	1.500.022	0,27	EUR	152.000	K+S AG 4.13% 06/12/2021	152.868	0,03
EUR	950.000	Rexel SA 2.13% 15/06/2028	976.069	0,18	EUR	3.400.000	Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	3.354.144	0,62
EUR	1.205.000	Rexel SA 2.75% 15/06/2026	1.232.835	0,23	EUR	1.290.000	Nidda Healthcare Holding GmbH 3.50% 30/09/2024	1.284.198	0,23
EUR	2.342.000	Solvay Finance SA Perp FRN	2.631.771	0,48	EUR	2.856.000	Novelis Sheet Ingot GmbH 3.38% 15/04/2029	2.983.985	0,55
EUR	600.000	SPCM SA 2.00% 01/02/2026	610.396	0,11	EUR	3.150.000	PCF GmbH 4.75% 15/04/2026	3.260.023	0,59
EUR	335.000	SPCM SA 2.63% 01/02/2029	344.344	0,06	EUR	1.796.000	Peach Property Finance GmbH 4.38% 15/11/2025	1.855.430	0,34
EUR	1.400.000	SPIE SA 2.63% 18/06/2026	1.466.399	0,27	EUR	1.735.000	Progroup AG 3.00% 31/03/2026	1.759.753	0,32
EUR	1.600.000	Valeo SA 1.00% 03/08/2028	1.588.418	0,29	EUR	900.000	Schaeffler AG 2.75% 12/10/2025	959.547	0,18
EUR	500.000	Valeo SA 1.50% 18/06/2025	518.898	0,09	EUR	1.000.000	Schaeffler AG 2.75% 12/10/2025	1.066.164	0,19
EUR	600.000	Valeo SA 1.63% 18/03/2026	625.393	0,11	EUR	1.246.000	Schaeffler AG 2.88% 26/03/2027	1.353.597	0,25
EUR	300.000	Valeo SA 3.25% 22/01/2024	322.235	0,06	EUR	1.900.000	Schaeffler AG 3.38% 12/10/2028	2.130.828	0,40
EUR	1.200.000	Veolia Environnement SA Perp FRN	1.234.549	0,23	EUR	700.000	Schaeffler AG 3.38% 12/10/2028	785.042	0,14
	<b>Total de Francia</b>	<b>86.551.100</b>	<b>15,78</b>		EUR	1.698.000	Schenck Process Holding GmbH/Darmstadt 5.38% 15/06/2023	1.713.844	0,31
					EUR	1.193.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 2.00% 15/07/2025	1.188.546	0,22
<b>ALEMANIA</b>					EUR	1.344.294	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 6.00% 30/07/2026	1.386.590	0,25
EUR	1.200.000	Adler Real Estate AG 1.88% 27/04/2023	1.104.480	0,20					
EUR	550.000	Adler Real Estate AG 2.13% 06/02/2024	500.594	0,09					
EUR	1.400.000	Adler Real Estate AG 3.00% 27/04/2026	1.232.779	0,23					
EUR	560.000	Ceramtec Bondco GmbH 5.25% 15/12/2025	573.143	0,10					
EUR	1.618.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.50% 11/02/2027	1.639.474	0,30					
EUR	898.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 4.38% 15/01/2028	935.545	0,17					
EUR	79.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 4.38% 15/01/2028	82.303	0,02					

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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>ALEMANIA (continuación)</b>				<b>ITALIA (continuación)</b>					
EUR	750.000	Tele Columbus AG 3.88% 02/05/2025	754.631	0,14	EUR	1.546.000	Autostrade per l'Italia 2.00% 15/01/2030	1.625.898	0,30
EUR	1.363.000	thyssenkrupp AG 2.50% 25/02/2025	1.406.044	0,26	EUR	584.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.63% 12/06/2023	595.637	0,11
EUR	1.798.000	Thyssenkrupp AG 2.88% 22/02/2024	1.848.345	0,33	EUR	742.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.75% 26/06/2026	767.681	0,14
EUR	162.000	TK Elevator Holdco GmbH 15/07/2027	169.542	0,03	EUR	1.070.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.75% 01/02/2027	1.108.286	0,20
EUR	2.165.000	TK Elevator Holdco GmbH 4.38% 15/07/2027	2.265.792	0,42	EUR	1.432.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.88% 04/11/2025	1.492.274	0,27
EUR	734.400	TK Elevator Holdingco GmbH 6.63% 15/07/2028	781.671	0,14	EUR	666.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.88% 26/09/2029	696.530	0,13
EUR	774.000	TUI Cruises GmbH 6.50% 15/05/2026	799.447	0,15	EUR	1.045.000	Autostrade per l'Italia SpA 4.38% 16/09/2025	1.194.543	0,22
EUR	100.000	ZF Finance GmbH 2.75% 25/05/2027	103.752	0,02	EUR	1.000.000	Autostrade per l'Italia SpA 5.88% 09/06/2024	1.144.164	0,21
EUR	1.100.000	ZF Finance GmbH 3.00% 21/09/2025	1.160.041	0,21	GBP	452.000	Autostrade per l'Italia SpA 6.25% 09/06/2022	544.148	0,10
EUR	1.400.000	ZF Finance GmbH 3.75% 21/09/2028	1.529.456	0,28	EUR	709.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1.88% 09/01/2026	713.643	0,13
	<b>Total de Alemania</b>		<b>61.335.125</b>	<b>11,23</b>	EUR	2.510.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 2.63% 28/04/2025	2.572.687	0,47
					EUR	926.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 3.63% 24/09/2024	967.417	0,18
<b>IRLANDA</b>					EUR	2.064.000	IMA Industria Macchine Automatiche SpA 3.75% 15/01/2028	2.083.869	0,38
EUR	818.000	Eircom Finance Dac 2.63% 15/02/2027	814.823	0,15	EUR	1.188.000	Infrastrutture Wireless Italiane SpA 1.88% 08/07/2026	1.237.374	0,23
EUR	2.715.000	Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	2.777.452	0,51	EUR	1.311.000	International Design Group SPA 6.50% 15/11/2025	1.359.991	0,25
EUR	833.000	James Hardie International Finance DAC 3.63% 01/10/2026	849.476	0,16	EUR	378.000	Leonardo SpA 1.50% 07/06/2024	388.172	0,07
GBP	1.126.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III 4.88% 15/07/2028	1.338.709	0,25	EUR	807.000	Leonardo SpA 2.38% 08/01/2026	848.619	0,16
	<b>Total de Irlanda</b>		<b>5.780.460</b>	<b>1,07</b>	EUR	690.000	Leonardo SpA 4.88% 24/03/2025	789.246	0,14
					EUR	1.707.000	Marcolin SpA 6.13% 15/11/2026	1.755.382	0,32
<b>ISLA DE MAN</b>					EUR	2.682.000	Nexi SpA 1.63% 30/04/2026	2.695.316	0,49
EUR	1.257.000	Playtech plc 3.75% 12/10/2023	1.271.824	0,23	EUR	2.508.000	Nexi SpA 2.13% 30/04/2029	2.506.867	0,46
EUR	484.000	Playtech plc 4.25% 07/03/2026	497.346	0,09	EUR	710.000	Rossini Sarl 6.75% 30/10/2025	737.509	0,13
	<b>Total de Isla de Man</b>		<b>1.769.170</b>	<b>0,32</b>	EUR	1.254.000	Telecom Italia SpA 1.63% 18/01/2029	1.230.767	0,22
					EUR	1.093.000	Telecom Italia SpA 2.50% 19/07/2023	1.136.424	0,21
<b>ITALIA</b>					EUR	1.943.000	Telecom Italia SpA 2.75% 15/04/2025	2.043.429	0,37
EUR	293.000	Atlantia SpA 1.63% 03/02/2025	301.335	0,06	EUR	275.000	Telecom Italia SpA 2.88% 28/01/2026	291.197	0,05
EUR	945.000	Atlantia SpA 1.88% 13/07/2027	986.600	0,17	EUR	261.000	Telecom Italia SpA 3.25% 16/01/2023	271.323	0,05
EUR	1.511.000	Atlantia SpA 1.88% 12/02/2028	1.575.703	0,29	EUR	1.780.000	Telecom Italia SpA 3.63% 25/05/2026	1.969.564	0,36
EUR	32.000	Autostrade per l'Italia 1.63% 12/06/2023	32.638	0,01					
EUR	1.716.000	Autostrade per l'Italia 2.00% 04/12/2028	1.806.057	0,33					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

### Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>ITALIA (continuación)</b>				<b>LUXEMBURGO (continuación)</b>					
EUR	1.164.000	Telecom Italia SpA 4.00% 11/04/2024	1.245.886	0,23	EUR	3.479.000	Altice France Holding SA 8.00% 15/05/2027	3.711.671	0,67
EUR	600.000	Telecom Italia SpA 5.25% 17/03/2055	733.182	0,13	EUR	2.101.801	ARD Finance SA 5.00% 30/06/2027	2.188.506	0,40
GBP	2.050.000	Telecom Italia SpA 5.88% 19/05/2023	2.556.630	0,47	GBP	1.897.000	B&M European Value Retail SA 3.63% 15/07/2025	2.275.501	0,41
EUR	1.050.000	Unipol Gruppo SpA 3.25% 23/09/2030	1.223.677	0,22	EUR	1.591.000	Canpack SA 2.38% 01/11/2027	1.626.653	0,30
		<b>Total de Italia</b>	<b>45.229.665</b>	<b>8,26</b>	EUR	138.000	Cidron Aida Finco Sarl 5.00% 01/04/2028	139.239	0,03
					GBP	1.094.000	Cidron Aida Finco Sarl 6.25% 01/04/2028	1.290.190	0,23
<b>JAPÓN</b>					EUR	1.481.000	Cirsa Finance International Sarl 4.50% 15/03/2027	1.469.040	0,27
EUR	730.000	SoftBank Group Corp 4.00% 20/04/2023	748.786	0,14	EUR	757.000	Cirsa Finance International Sarl 4.75% 22/05/2025	760.584	0,14
EUR	1.477.000	SoftBank Group Corp 5.00% 15/04/2028	1.551.265	0,28	EUR	2.015.931	Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	2.050.520	0,37
EUR	1.246.000	Softbank Group Corp. 3.13% 19/09/2025	1.247.254	0,23	EUR	743.000	CPI Property Group SA Perp FRN	786.975	0,14
EUR	916.000	SoftBank Group Corp. 2.88% 06/01/2027	878.655	0,16	EUR	1.034.000	Crystal Almond Sarl 4.25% 15/10/2024	1.058.430	0,19
EUR	964.000	SoftBank Group Corp. 3.88% 06/07/2032	912.160	0,17	EUR	1.239.000	Flamingo Lux II 5.00% 31/03/2029	1.230.970	0,22
		<b>Total de Japón</b>	<b>5.338.120</b>	<b>0,98</b>	EUR	1.139.000	Garfunkelux Holdingco 3 SA 6.75% 01/11/2025	1.192.218	0,22
<b>JERSEY - ISLAS DEL CANAL</b>					GBP	1.668.000	Garfunkelux Holdingco 3 SA 7.75% 01/11/2025	2.032.901	0,37
EUR	1.797.000	Adient Global Holdings Limited 3.50% 15/08/2024	1.814.788	0,33	EUR	1.100.000	Grand City Properties SA Perp FRN	1.085.546	0,20
EUR	3.248.000	Avis Budget Finance plc 4.75% 30/01/2026	3.321.955	0,62	EUR	857.000	Groupe Ecore Holding SAS FRN 15/11/2023	872.277	0,16
		<b>Total de Jersey - Islas del Canal</b>	<b>5.136.743</b>	<b>0,95</b>	EUR	1.599.000	Hanesbrands Inc. 3.50% 15/06/2024	1.708.189	0,31
<b>LUXEMBURGO</b>					EUR	712.000	Holcim Finance Luxembourg SA Perp FRN	746.759	0,14
EUR	2.100.000	Adler Group SA 1.88% 14/01/2026	1.791.806	0,33	EUR	1.099.000	HSE Finance Sarl 5.63% 15/10/2026	1.145.361	0,21
EUR	1.400.000	Adler Group SA 2.25% 14/01/2029	1.146.504	0,21	EUR	3.149.000	InPost SA 2.25% 15/07/2027	3.186.526	0,59
EUR	700.000	Adler Group SA 2.75% 13/11/2026	604.289	0,11	EUR	1.393.000	Kleopatra Finco Sarl 4.25% 01/03/2026	1.367.577	0,25
EUR	1.300.000	Adler Group SA 3.25% 05/08/2025	1.152.505	0,21	EUR	43.000	Kleopatra Finco Sarl 4.25% 01/03/2026	42.215	0,01
EUR	710.000	Altice Financing SA 2.25% 15/01/2025	686.079	0,13	EUR	410.000	Kleopatra Holdings 2 6.50% 01/09/2026	388.461	0,07
EUR	1.728.000	Altice Financing SA 3.00% 15/01/2028	1.635.445	0,30	EUR	1.224.800	Lhmc Finco 2 Sarl 7.25% 02/10/2025	1.247.425	0,23
EUR	2.122.000	Altice Finco SA 4.75% 15/01/2028	2.029.104	0,37	EUR	2.064.000	Lincoln Financing SARL 3.63% 01/04/2024	2.084.693	0,38
EUR	100.000	Altice France Holding SA 4.00% 15/02/2028	94.468	0,02	EUR	826.000	Matterhorn Telecom SA 3.13% 15/09/2026	827.564	0,15

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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>LUXEMBURGO (continuación)</b>				<b>PAÍSES BAJOS (continuación)</b>					
EUR	779.000	Picard Bondco SA 5.38% 01/07/2027	787.226	0,14	EUR	1.015.000	PPF Telecom Group BV 3.25% 29/09/2027	1.104.508	0,20
EUR	1.978.000	Sani/lkos Financial Holdings 1 Sarl 5.63% 15/12/2026	2.024.673	0,37	EUR	712.000	PPF Telecom Group BV 3.50% 20/05/2024	760.307	0,14
EUR	1.120.000	Telecom Italia Finance SA 7.75% 24/01/2033	1.638.931	0,30	EUR	822.000	Q-Park Holding I BV 1.50% 01/03/2025	792.019	0,14
EUR	900.000	Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl 3.50% 01/03/2028	933.722	0,17	EUR	412.000	Q-Park Holding I BV 2.00% 01/03/2027	394.651	0,07
		<b>Total de Luxemburgo</b>	<b>51.040.743</b>	<b>9,32</b>	EUR	937.000	Repsol International Finance BV FRN 25/03/2075	1.022.037	0,19
<b>MÉXICO</b>					EUR	1.532.000	Repsol International Finance BV Perp FRN	1.540.753	0,28
EUR	200.000	Cemex Sab de Cv 3.13% 19/03/2026	204.731	0,04	EUR	1.635.000	Repsol International Finance BV Perp FRN	1.744.286	0,32
EUR	246.154	Cemex SAB de CV 2.75% 05/12/2024	248.682	0,05	EUR	462.000	Repsol International Finance BV Perp FRN	492.881	0,09
EUR	2.110.000	Petroleos Mexicanos 2.75% 21/04/2027	1.992.207	0,36	EUR	1.442.000	Repsol International Finance BV Perp FRN	1.584.237	0,29
EUR	1.465.000	Petroleos Mexicanos 4.75% 26/02/2029	1.455.489	0,27	EUR	803.000	Saipem Finance International BV 3.38% 15/07/2026	829.062	0,15
EUR	2.038.000	Petroleos Mexicanos 4.88% 21/02/2028	2.065.921	0,37	EUR	1.214.059	Summer Bidco BV 9.00% 15/11/2025	1.244.104	0,23
		<b>Total de México</b>	<b>5.967.030</b>	<b>1,09</b>	EUR	962.128	Summer Bidco BV 9.00% 15/11/2025	985.939	0,18
<b>PAÍSES BAJOS</b>					EUR	1.400.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	1.365.869	0,25
EUR	1.500.000	Abertis Finance BV Perp FRN	1.484.632	0,27	EUR	700.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	724.260	0,13
EUR	1.961.000	Ashland Services BV 2.00% 30/01/2028	2.030.581	0,37	EUR	3.500.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	3.799.044	0,69
EUR	1.910.000	Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	1.947.028	0,36	EUR	4.000.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	4.347.064	0,79
EUR	1.437.000	Diebold Nixdorf Dutch Holding BV 9.00% 15/07/2025	1.564.753	0,29	EUR	1.200.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	1.333.059	0,24
EUR	200.000	Dufry One BV 2.50% 15/10/2024	198.103	0,04	EUR	2.009.000	Tennet Holding BV Perp FRN	2.109.060	0,39
EUR	961.000	Dufry One BV 3.38% 15/04/2028	956.556	0,17	EUR	495.000	Tennet Holding BV Perp FRN	522.730	0,10
EUR	1.144.000	Goodyear Europe BV 2.75% 15/08/2028	1.155.398	0,21	EUR	775.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.13% 15/10/2024	739.263	0,14
EUR	2.246.000	Intertrust Group BV 3.38% 15/11/2025	2.287.405	0,42	EUR	1.871.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.25% 31/03/2023	1.840.924	0,34
EUR	400.000	Lkq European Holdings BV 4.13% 01/04/2028	429.121	0,08	EUR	460.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.63% 15/10/2028	417.033	0,08
EUR	2.964.000	Nobel Bidco BV 3.13% 15/06/2028	2.952.037	0,54	EUR	725.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.88% 31/03/2027	680.485	0,12
EUR	1.012.000	Oci NV 3.63% 15/10/2025	1.052.190	0,19	EUR	815.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.50% 01/03/2025	846.764	0,15
EUR	1.200.000	Phoenix Pib Dutch Finance BV 2.38% 05/08/2025	1.239.693	0,23	EUR	1.495.000	United Group BV 3.13% 15/02/2026	1.449.148	0,26
EUR	824.000	PPF Telecom Group BV 2.13% 31/01/2025	850.708	0,16	EUR	492.000	United Group BV 3.63% 15/02/2028	476.308	0,09
EUR	600.000	PPF Telecom Group BV 3.13% 27/03/2026	644.387	0,12					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

### Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo			
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>						
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>						
<b>PAÍSES BAJOS (continuación)</b>				<b>ESPAÑA (continuación)</b>						
EUR	612.000	United Group BV 4.63% 15/08/2028	615.816	0,11	EUR	1.943.000	Grifols SA 2.25% 15/11/2027	1.953.433	0,36	
EUR	741.000	United Group BV 4.88% 01/07/2024	751.418	0,14	EUR	1.282.000	Grifols SA 3.20% 01/05/2025	1.288.042	0,24	
EUR	891.000	UPC Holding BV 3.88% 15/06/2029	916.675	0,17	EUR	686.000	Grupo Antolin-Irausa SA 3.38% 30/04/2026	674.733	0,12	
EUR	3.299.000	Vz Vendor Financing II BV 2.88% 15/01/2029	3.270.873	0,60	<b>Total de España</b>			<b>13.319.874</b>	<b>2,44</b>	
EUR	800.000	ZF Europe Finance BV 3.00% 23/10/2029	833.675	0,15	<b>SUECIA</b>					
<b>Total de Paises Bajos</b>				<b>58.326.844</b>	<b>10,67</b>	EUR	647.000	Akelius Residential Property AB FRN 05/10/2078	683.612	0,12
<b>PANAMÁ</b>					EUR	1.940.000	Heimstaden Bostad AB Perp FRN	1.896.853	0,35	
EUR	3.467.000	Carnival Corp. 7.63% 01/03/2026	3.756.909	0,68	EUR	820.000	Heimstaden Bostad AB Perp FRN	812.181	0,15	
<b>Total de Panamá</b>				<b>3.756.909</b>	<b>0,68</b>	EUR	950.000	Heimstaden Bostad AB Perp FRN	976.212	0,18
<b>PORTUGAL</b>					EUR	1.866.000	Heimstaden Bostad AB Perp FRN	1.917.380	0,36	
EUR	800.000	Edp - Energias de Portugal SA FRN 20/07/2080	810.733	0,15	EUR	804.000	Intrum AB 3.00% 15/09/2027	803.643	0,15	
EUR	100.000	Edp - Energias de Portugal SA FRN 30/04/2079	108.656	0,02	EUR	1.735.000	Intrum AB 3.50% 15/07/2026	1.778.534	0,33	
EUR	800.000	EDP - Energias de Portugal SA 1.50% 14/03/2082	787.936	0,14	EUR	1.112.000	Samhallsbyggnadsbolaget Perp FRN	1.114.722	0,20	
<b>Total de Portugal</b>				<b>1.707.325</b>	<b>0,31</b>	EUR	2.784.000	Verisure Holding AB 3.25% 15/02/2027	2.803.715	0,52
<b>RUMANÍA</b>					EUR	80.000	Verisure Holding AB 3.25% 15/02/2027	80.566	0,01	
EUR	900.000	RCS & RDS SA 3.25% 05/02/2028	901.538	0,16	EUR	736.000	Verisure Holding AB 3.88% 15/07/2026	756.107	0,14	
<b>Total de Rumanía</b>				<b>901.538</b>	<b>0,16</b>	EUR	2.236.000	Verisure Midholding AB 5.25% 15/02/2029	2.299.351	0,42
<b>ESPAÑA</b>					EUR	742.000	Verisure Midholding AB 5.25% 15/02/2029	763.023	0,14	
EUR	1.400.000	Cellnex Finance Company 2.00% 15/02/2033	1.370.045	0,25	EUR	322.000	Volvo Car AB 2.13% 02/04/2024	335.319	0,06	
EUR	1.300.000	Cellnex Finance Company SA 1.00% 15/09/2027	1.278.409	0,23	EUR	706.000	Volvo Car AB 2.50% 07/10/2027	771.039	0,14	
EUR	1.600.000	Cellnex Finance Company SA 1.25% 15/01/2029	1.561.791	0,29	<b>Total de Suecia</b>			<b>17.792.257</b>	<b>3,27</b>	
EUR	1.300.000	Cellnex Finance Company SA 1.50% 08/06/2028	1.303.483	0,24	<b>SUIZA</b>					
EUR	500.000	Cellnex Telecom SA 1.00% 20/04/2027	494.747	0,09	USD	859.000	Credit Suisse Group AG Perp FRN	811.188	0,15	
EUR	500.000	Cellnex Telecom SA 1.88% 26/06/2029	507.407	0,09	EUR	774.000	UBS Group AG Perp FRN	787.764	0,14	
EUR	700.000	Cellnex Telecom SA 2.88% 18/04/2025	755.448	0,14	<b>Total de Suiza</b>			<b>1.598.952</b>	<b>0,29</b>	
EUR	2.105.000	Grifols Escrow Issuer SA 3.88% 15/10/2028	2.132.336	0,39	<b>REINO UNIDO</b>					
					GBP	968.000	Arqiva Broadcast Finance plc 6.75% 30/09/2023	1.149.581	0,21	
					GBP	1.079.000	Arrow Global Finance 5.13% 15/09/2024	1.258.527	0,23	

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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>REINO UNIDO (continuación)</b>				<b>REINO UNIDO (continuación)</b>					
GBP	2.196.000	Boparan Finance plc 7.63% 30/11/2025	2.262.051	0,41	EUR	702.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 5.88% 15/11/2024	750.475	0,14
EUR	1.097.000	BP Capital Markets plc Perp FRN	1.173.276	0,21	EUR	2.267.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 6.88% 15/11/2026	2.530.850	0,46
EUR	786.000	BP Capital Markets plc Perp FRN	853.412	0,16	GBP	1.141.000	Jerrold Finco plc 5.25% 15/01/2027	1.384.344	0,25
GBP	510.000	Centrica plc FRN 10/04/2075	633.945	0,12	GBP	970.000	Marks & Spencer plc 3.75% 19/05/2026	1.177.548	0,22
GBP	1.431.000	Constellation Automotive Financing plc 4.88% 15/07/2027	1.655.506	0,30	EUR	1.522.000	Modulaire Global Finance plc 6.50% 15/02/2023	1.550.747	0,28
GBP	1.135.000	Co-operative Group FRN 08/07/2026	1.585.779	0,29	EUR	1.508.000	Nomad Foods Bondco plc 2.50% 24/06/2028	1.534.557	0,28
GBP	721.000	Co-Operative Group Limited 5.13% 17/05/2024	894.755	0,16	EUR	446.000	Pinnacle Bidco plc 5.50% 15/02/2025	459.820	0,08
GBP	2.718.000	Deuce Finco plc 5.50% 15/06/2027	3.207.515	0,59	GBP	1.540.000	Pinnacle Bidco plc 6.38% 15/02/2025	1.831.398	0,33
EUR	2.611.000	EC Finance plc 2.38% 15/11/2022	2.625.445	0,48	GBP	1.156.000	Premier Foods Finance plc 3.50% 15/10/2026	1.357.571	0,25
EUR	1.581.000	EC Finance plc 3.00% 15/10/2026	1.593.692	0,29	GBP	2.596.000	Punch Finance plc 6.13% 30/06/2026	3.097.142	0,57
EUR	749.000	EG Global Finance plc 4.38% 07/02/2025	746.159	0,14	EUR	1.643.000	Rolls-Royce plc 4.63% 16/02/2026	1.823.284	0,33
EUR	708.000	EG Global Finance plc 6.25% 30/10/2025	725.462	0,13	GBP	714.000	Rolls-Royce plc 5.75% 15/10/2027	925.088	0,17
USD	1.020.630	Enquest plc 7.00% 15/04/2022	850.378	0,16	GBP	1.377.000	Santander UK plc Perp 10.06% 31/03/2026	2.857.630	0,52
EUR	1.937.000	Ineos Finance plc 2.88% 01/05/2026	1.957.814	0,36	EUR	908.000	Synthomer plc 3.88% 01/07/2025	941.310	0,17
EUR	396.000	Ineos Finance plc 3.38% 31/03/2026	405.396	0,07	GBP	989.000	Travis Perkins plc 3.75% 17/02/2026	1.225.169	0,22
EUR	100.000	Ineos Finance plc 3.38% 31/03/2026	102.373	0,02	EUR	885.000	Victoria plc 3.63% 26/08/2026	907.351	0,17
EUR	2.215.000	Ineos Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	2.240.577	0,41	EUR	1.961.000	Victoria plc 3.75% 15/03/2028	2.016.187	0,36
EUR	530.000	Ineos Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	536.120	0,10	GBP	603.000	Virgin Media Secured Finance plc 4.25% 15/01/2030	710.927	0,13
GBP	1.871.000	Inspired Entertainment Financing plc 7.88% 01/06/2026	2.242.084	0,41	GBP	966.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.00% 15/04/2027	1.167.021	0,21
EUR	1.080.000	International Game Technology plc 2.38% 15/04/2028	1.067.546	0,20	GBP	409.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.25% 15/05/2029	504.426	0,09
EUR	1.407.000	International Game Technology plc 3.50% 15/07/2024	1.481.435	0,27	EUR	2.106.000	Vmed O2 UK Financing I plc 3.25% 31/01/2031	2.166.961	0,40
EUR	1.627.000	International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	1.672.163	0,31	EUR	976.000	Vodafone Group plc FRN 27/08/2080	1.011.551	0,18
GBP	2.630.000	Iron Mountain UK plc 3.88% 15/11/2025	3.099.971	0,57	EUR	724.000	Vodafone Group plc FRN 27/08/2080	746.995	0,14
EUR	320.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 2.20% 15/01/2024	313.437	0,06	EUR	1.396.000	Vodafone Group plc FRN 03/01/2079	1.452.308	0,27
GBP	1.087.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 3.88% 01/03/2023	1.280.142	0,23	EUR	1.931.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	2.189.117	0,40
EUR	702.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 4.50% 15/07/2028	693.600	0,13	GBP	335.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	420.469	0,08

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			
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>						
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>						
<b>REINO UNIDO (continuación)</b>				<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>						
USD	1.927.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	1.830.518	0,33	GBP	848.000	MPT Operating Partnership LP 3.69% 05/06/2028	1.052.462	0,19	
USD	1.105.000	Vodafone Group plc FRN 04/04/2079	1.167.379	0,21	EUR	3.831.000	Netflix Inc. 3.63% 15/05/2027	4.434.352	0,82	
<b>Total del Reino Unido</b>				<b>78.046.284</b>	<b>14,26</b>	EUR	743.000	Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	892.194	0,16
<b>ESTADOS UNIDOS</b>				<b>ESTADOS UNIDOS</b>						
EUR	1.548.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 2.00% 01/09/2028	1.563.791	0,29	EUR	1.572.000	Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	1.905.800	0,35	
EUR	2.139.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 3.00% 01/09/2029	2.147.782	0,39	EUR	3.186.000	Netflix Inc. 4.63% 15/05/2029	4.001.393	0,73	
EUR	1.792.000	Avantor Funding Inc. 2.63% 01/11/2025	1.835.909	0,34	EUR	1.590.000	Olympus Water USA 3.88% 01/10/2028	1.593.923	0,29	
EUR	562.000	Ball Corp. 0.88% 15/03/2024	567.668	0,10	EUR	760.000	Olympus Water USA 5.38% 01/10/2029	752.559	0,14	
EUR	2.337.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 2.38% 01/03/2028	2.370.491	0,43	EUR	1.444.000	Organon & Company 2.88% 30/04/2028	1.476.908	0,27	
EUR	665.000	Ford Motor Credit Company LLC 1.36% 07/02/2025	662.506	0,12	EUR	2.000.000	Scientific Games International Inc. 5.50% 15/02/2026	2.067.785	0,37	
EUR	1.154.000	Ford Motor Credit Company LLC 1.74% 19/07/2024	1.170.619	0,21	EUR	811.000	Silgan Holdings Inc. 3.25% 15/03/2025	818.292	0,15	
EUR	1.724.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.33% 25/11/2025	1.776.210	0,32	EUR	1.541.000	Spectrum Brands Inc. 4.00% 01/10/2026	1.577.243	0,29	
EUR	291.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.39% 17/02/2026	300.662	0,05	<b>Total de Estados Unidos</b>			<b>49.801.228</b>	<b>9,10</b>	
EUR	371.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.39% 17/02/2026	383.318	0,07	<b>Total de bonos</b>			<b>504.617.336</b>	<b>92,22</b>	
GBP	1.425.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.75% 14/06/2024	1.678.051	0,31	<b>Valores respaldados por hipotecas y activos</b>					
EUR	3.310.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.02% 06/03/2024	3.457.048	0,64	<b>FRANCIA</b>					
EUR	2.081.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.25% 15/09/2025	2.221.342	0,41	EUR	414.857	Iqera Group SAS FRN 30/09/2024	415.462	0,08	
GBP	447.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.54% 06/03/2025	554.862	0,10	<b>Total de Francia</b>			<b>415.462</b>	<b>0,08</b>	
EUR	2.617.000	Iqvia Inc. 2.25% 15/01/2028	2.639.340	0,48	<b>Total de valores respaldados por hipotecas y activos</b>					
EUR	2.730.000	Iqvia Inc. 2.25% 15/03/2029	2.747.963	0,50	<b>415.462 0,08</b>					
EUR	1.086.000	Iqvia Inc. 2.88% 15/06/2028	1.118.384	0,20	<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>					
EUR	653.000	Kraft Heinz Foods Company 2.25% 25/05/2028	711.227	0,13	<b>505.032.798 92,30</b>					
GBP	443.000	Kraft Heinz Foods Company 4.13% 01/07/2027	574.989	0,11	<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente</b>					
EUR	686.000	MPT Operating Partnership LP 3.33% 24/03/2025	746.155	0,14	<b>Bonos</b>					
				<b>REINO UNIDO</b>						
GBP	4.949.000	Bellis Acquisition Company 3.25% 16/02/2026	5.673.585	1,04	GBP	2.487.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	2.937.333	0,53	

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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)</b>				<b>Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Fondos</b>					
<b>REINO UNIDO (continuación)</b>				<b>IRLANDA</b>					
GBP	985.000	Virgin Media Secured Finance plc 4.13% 15/08/2030	1.157.109	0,21	970.542	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	1.129.152	0,21	
		<b>Total del Reino Unido</b>	<b>9.768.027</b>	<b>1,78</b>	268.570	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	26.471.705	4,84	
<b>Total de bonos</b>				<b>9.768.027</b>	<b>1,78</b>	1.009.414	Insight Liquidity Funds plc	1.174.376	0,21
<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente</b>				<b>9.768.027</b>	<b>1,78</b>	<b>Total de Irlanda</b>		<b>28.775.233</b>	<b>5,26</b>
<b>Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario</b>						<b>Total de fondos</b>		<b>28.775.233</b>	<b>5,26</b>
<b>Bonos</b>						<b>Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>		<b>28.775.233</b>	<b>5,26</b>
<b>PORTUGAL</b>						<b>Valor total de las inversiones</b>		<b>549.347.382</b>	<b>100,39</b>
EUR	1.000.000	Banco Espirito Santo SA 2.63% 31/12/2049	110.000	0,02	<b>(Coste total: 537.104.452 EUR)</b>				
EUR	6.900.000	Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2022	759.000	0,14					
EUR	1.400.000	Banco Espirito Santo SA 4.75% 15/01/2022	154.000	0,03					
<b>Total de Portugal</b>				<b>1.023.000</b>	<b>0,19</b>				
<b>REINO UNIDO</b>									
GBP	1.083.000	Miller Homes Group Holdings plc 5.50% 15/10/2024	1.278.470	0,23					
GBP	878.000	Talktalk Telecom Group plc 3.88% 20/02/2025	1.003.593	0,18					
GBP	2.070.000	Vmed O2 UK Financing I plc 4.50% 15/07/2031	2.466.261	0,45					
<b>Total del Reino Unido</b>				<b>4.748.324</b>	<b>0,86</b>				
<b>Total de bonos</b>				<b>5.771.324</b>	<b>1,05</b>				
<b>Renta variable</b>									
<b>REINO UNIDO</b>									
434		Nv Profit Share Limited	0	0,00					
<b>Total del Reino Unido</b>				<b>0</b>	<b>0,00</b>				
<b>Total de renta variable</b>				<b>0</b>	<b>0,00</b>				
<b>Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario</b>				<b>5.771.324</b>	<b>1,05</b>				

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 2021

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Bonos</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>DINAMARCA</b>				<b>FRANCIA (continuación)</b>					
EUR	150.000	Dkt Finance Aps 7.00% 17/06/2023	153.079	0,15	EUR	300.000	SPIE SA 3.13% 22/03/2024	315.332	0,30
EUR	236.000	TDC A/S 5.00% 02/03/2022	240.843	0,23	EUR	700.000	Valeo SA 3.25% 22/01/2024	751.882	0,73
<b>Total de Dinamarca</b>				<b>393.922</b>	<b>0,38</b>	<b>Total de Francia</b>		<b>13.396.893</b>	<b>13,03</b>
<b>FRANCIA</b>				<b>ALEMANIA</b>					
EUR	316.000	Altice France SA 2.13% 15/02/2025	307.526	0,30	EUR	400.000	Adler Real Estate AG 1.50% 17/04/2022	383.229	0,37
EUR	1.056.000	Altice France SA 2.50% 15/01/2025	1.039.703	1,02	EUR	1.300.000	Adler Real Estate AG 1.88% 27/04/2023	1.196.520	1,17
EUR	610.000	Banijay Entertainment Sasu 3.50% 01/03/2025	617.752	0,60	EUR	360.000	Adler Real Estate AG 2.13% 06/02/2024	327.662	0,32
EUR	400.000	Casino Guichard Perrachon SA 1.87% 13/06/2022	399.495	0,39	EUR	250.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.50% 11/02/2027	253.318	0,25
EUR	289.000	Casino Guichard Perrachon SA 6.63% 15/01/2026	302.234	0,29	EUR	200.000	Demire Deutsche Mittelstand Real Estate AG 1.88% 15/10/2024	191.165	0,19
EUR	200.000	Casino Guichard-Perrachon SA 4.50% 07/03/2024	201.844	0,20	EUR	200.000	Deutsche Lufthansa AG 2.00% 14/07/2024	204.041	0,20
EUR	416.000	CMA CGM SA 5.25% 15/01/2025	422.352	0,41	EUR	200.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 11/02/2025	206.887	0,20
EUR	505.000	CMA CGM SA 7.50% 15/01/2026	560.576	0,55	EUR	300.000	Deutsche Lufthansa AG 3.00% 29/05/2026	309.827	0,30
EUR	100.000	Crown European Holdings 3.38% 15/05/2025	107.545	0,10	EUR	126.000	Gruenthal GmbH 3.63% 15/11/2026	130.903	0,13
EUR	1.147.000	Crown European Holdings 4.00% 15/07/2022	1.171.861	1,14	EUR	522.000	HT Troplast AG 9.25% 15/07/2025	573.933	0,56
EUR	147.000	Crown European Holdings SA 0.75% 15/02/2023	147.384	0,14	EUR	1.000.000	IHO Verwaltungs GmbH 3.63% 15/05/2025	1.017.758	0,99
EUR	100.000	Crown European Holdings SA 2.25% 01/02/2023	102.074	0,10	EUR	682.000	K+S AG 4.13% 06/12/2021	685.893	0,67
EUR	175.000	Elior Group SA 3.75% 15/07/2026	181.553	0,18	EUR	490.000	PCF GmbH 4.75% 15/04/2026	507.115	0,49
EUR	500.000	Elis SA 1.88% 15/02/2023	507.982	0,49	EUR	1.180.000	Peach Property Finance GmbH 3.50% 15/02/2023	1.197.017	1,16
EUR	136.000	Faurecia 2.63% 15/06/2025	137.796	0,13	EUR	319.000	Peach Property Finance GmbH 4.38% 15/11/2025	329.556	0,32
EUR	1.291.000	Faurecia 2.63% 15/06/2025	1.308.047	1,28	EUR	784.000	Schaeffler AG 1.13% 26/03/2022	787.165	0,77
EUR	1.048.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	1.087.656	1,05	EUR	979.000	Schenck Process Holding GmbH/Darmstadt 5.38% 15/06/2023	988.135	0,96
EUR	799.000	Iqera Group SAS 6.50% 30/09/2024	826.086	0,80	EUR	496.000	SGL Carbon SE 4.63% 30/09/2024	506.322	0,49
EUR	350.000	La Financiere Atalian SASU 4.00% 15/05/2024	344.724	0,34	EUR	720.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 2.00% 15/07/2025	717.312	0,70
EUR	101.000	Loxam SAS 3.25% 14/01/2025	102.216	0,10	EUR	454.000	Tele Columbus AG 3.88% 02/05/2025	456.803	0,45
EUR	300.000	Loxam SAS 3.50% 15/04/2022	300.402	0,29	EUR	407.000	Thyssenkrupp AG 1.38% 03/03/2022	407.402	0,40
EUR	300.000	Loxam SAS 3.50% 03/05/2023	300.368	0,29	EUR	75.000	Thyssenkrupp AG 1.88% 06/03/2023	75.578	0,07
EUR	100.000	Orano SA 3.13% 20/03/2023	103.810	0,10					
EUR	620.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	632.869	0,62					
EUR	363.000	Parts Europe SA 6.50% 16/07/2025	379.361	0,37					
EUR	313.000	Picard Groupe SAS 3.88% 01/07/2026	318.554	0,31					
EUR	405.000	Quatrim Sasu 5.88% 15/01/2024	417.909	0,41					

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
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>			
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>			
<b>ALEMANIA (continuación)</b>				<b>JAPÓN (continuación)</b>			
EUR	739.000 Thyssenkrupp AG 2.88% 22/02/2024	759.692	0,74	EUR	125.000 Softbank Group Corp. 4.00% 30/07/2022	127.532	0,12
EUR	500.000 TUI Cruises GmbH 6.50% 15/05/2026	516.438	0,51	EUR	500.000 SoftBank Group Corp. 2.13% 06/07/2024	495.471	0,48
<b>Total de Alemania</b>		<b>12.729.671</b>	<b>12,41</b>	<b>Total de Japón</b>		<b>756.348</b>	<b>0,73</b>
<b>IRLANDA</b>				<b>JERSEY - ISLAS DEL CANAL</b>			
EUR	1.283.000 Eircom Finance Dac 1.75% 01/11/2024	1.290.235	1,25	EUR	877.000 Adient Global Holdings Limited 3.50% 15/08/2024	885.681	0,86
<b>Total de Irlanda</b>		<b>1.290.235</b>	<b>1,25</b>	EUR	664.000 Avis Budget Finance plc 4.13% 15/11/2024	675.388	0,66
<b>ISLA DE MAN</b>				<b>Total de Jersey - Islas del Canal</b>			
EUR	1.476.000 Playtech plc 3.75% 12/10/2023	1.493.406	1,45			<b>1.561.069</b>	<b>1,52</b>
EUR	210.000 Playtech plc 4.25% 07/03/2026	215.791	0,21	<b>LUXEMBURGO</b>			
<b>Total de Isla de Man</b>		<b>1.709.197</b>	<b>1,66</b>	EUR	750.000 Altice Financing SA 2.25% 15/01/2025	724.732	0,71
<b>ITALIA</b>				EUR	158.000 Arcelormittal SA 1.00% 19/05/2023	160.306	0,16
GBP	150.000 Aeroporti di Roma SpA 5.44% 20/02/2023	185.069	0,18	GBP	812.000 B&M European Value Retail SA 3.63% 15/07/2025	974.015	0,95
EUR	530.000 Autostrade per l'Italia 1.63% 12/06/2023	540.560	0,52	EUR	444.965 Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	452.600	0,44
EUR	400.000 Autostrade per l'Italia SpA 5.88% 09/06/2024	457.666	0,45	EUR	916.000 Crystal Almond Sarl 4.25% 15/10/2024	937.643	0,92
EUR	686.000 Gamma Bidco SpA 5.13% 15/07/2025	701.878	0,68	EUR	260.000 Garfunkelux Holdingco 3 SA 6.75% 01/11/2025	272.148	0,27
EUR	1.144.000 Lkq Italia Bondco 3.88% 01/04/2024	1.235.287	1,20	GBP	143.000 Garfunkelux Holdingco 3 SA 7.75% 01/11/2025	174.283	0,17
EUR	262.000 Marcolin SpA 6.13% 15/11/2026	269.426	0,26	EUR	260.000 Groupe Ecore Holding SAS FRN 15/11/2023	264.635	0,26
EUR	428.000 Nexi SpA 1.63% 30/04/2026	430.125	0,42	EUR	350.000 Hanesbrands Inc. 3.50% 15/06/2024	373.900	0,36
EUR	1.228.000 Nexi SpA 1.75% 31/10/2024	1.258.221	1,23	EUR	493.000 HSE Finance Sarl 5.63% 15/10/2026	513.797	0,50
EUR	581.000 Rossini Sarl 6.75% 30/10/2025	603.511	0,59	EUR	1.270.000 Ineos Group Holdings SA 5.38% 01/08/2024	1.271.792	1,24
EUR	577.000 Telecom Italia SpA 2.50% 19/07/2023	599.924	0,58	EUR	208.000 Kleopatra Finco Sarl 4.25% 01/03/2026	204.204	0,20
EUR	100.000 Telecom Italia SpA 2.75% 15/04/2025	105.169	0,10	EUR	150.000 Leonardo SpA 5.25% 21/01/2022	152.282	0,15
EUR	500.000 Telecom Italia SpA 4.00% 11/04/2024	535.174	0,52	EUR	100.000 Lincoln Financing SARL 3.63% 01/04/2024	101.003	0,10
EUR	100.000 Telecom Italia SpA 5.25% 10/02/2022	101.902	0,10	EUR	800.000 Matterhorn Telecom SA 2.63% 15/09/2024	807.033	0,79
<b>Total de Italia</b>		<b>7.023.912</b>	<b>6,83</b>	EUR	375.000 PLT VII Finance sarl 4.63% 05/01/2026	386.598	0,38
<b>JAPÓN</b>				EUR	100.000 PLT VII Finance sarl 4.63% 05/01/2026	103.093	0,10
EUR	130.000 SoftBank Group Corp 4.00% 20/04/2023	133.345	0,13				

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				
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>							
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>							
<b>LUXEMBURGO (continuación)</b>				<b>RUMANÍA</b>							
EUR	322.000	Sani/Ikos Financial Holdings 1 Sarl 5.63% 15/12/2026	329.598	0,32	EUR	600.000	RCS & RDS SA 2.50% 05/02/2025	600.193	0,58		
EUR	232.000	Sig Combibloc Purchaseco Sarl 1.88% 18/06/2023	239.140	0,23	<b>Total de Rumanía</b>			<b>600.193</b>	<b>0,58</b>		
<b>Total de Luxemburgo</b>				<b>8.442.802</b>	<b>8,25</b>	<b>ESPAÑA</b>					
<b>MÉXICO</b>				<b>ESPAÑA</b>							
EUR	385.000	Petroleos Mexicanos 2.50% 24/11/2022	391.620	0,38	EUR	300.000	Cellnex Telecom SA 2.38% 16/01/2024	313.941	0,31		
EUR	247.000	Petroleos Mexicanos 3.75% 21/02/2024	255.531	0,25	EUR	1.260.000	Gestamp Automocion SA 3.25% 30/04/2026	1.275.489	1,24		
<b>Total de México</b>				<b>647.151</b>	<b>0,63</b>	EUR	150.000	Grifols SA 1.63% 15/02/2025	150.447	0,15	
<b>PAÍSES BAJOS</b>				<b>ESPAÑA</b>							
EUR	610.000	Constellium NV 4.25% 15/02/2026	619.269	0,60	EUR	1.600.000	Grifols SA 3.20% 01/05/2025	1.607.540	1,57		
EUR	475.000	Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	484.209	0,47	EUR	500.000	Grupo Antolin-Irausa SA 3.38% 30/04/2026	491.788	0,48		
EUR	671.000	Diebold Nixdorf Dutch Holding BV 9.00% 15/07/2025	730.654	0,71	EUR	300.000	International Consolidated Airlines Group SA 2.75% 25/03/2025	303.617	0,30		
EUR	150.000	Intertrust Group BV 3.38% 15/11/2025	152.765	0,15	<b>Total de España</b>			<b>4.142.822</b>	<b>4,05</b>		
EUR	450.000	Kongsberg Actuation Systems BV 5.00% 15/07/2025	451.146	0,44	<b>SUECIA</b>						
EUR	1.604.000	Oci NV 3.13% 01/11/2024	1.630.881	1,59	EUR	400.000	Intrum Justitia AB 3.13% 15/07/2024	402.462	0,39		
EUR	685.000	OI European Group BV 3.13% 15/11/2024	709.578	0,69	EUR	1.482.000	Verisure Holding AB 3.50% 15/05/2023	1.496.603	1,45		
EUR	475.000	PPF Telecom Group BV 2.13% 31/01/2025	490.396	0,48	<b>Total de Suecia</b>			<b>1.899.065</b>	<b>1,84</b>		
EUR	468.000	PPF Telecom Group BV 3.50% 20/05/2024	499.752	0,49	<b>REINO UNIDO</b>						
EUR	246.000	Q-Park Holding I BV 1.50% 01/03/2025	237.028	0,23	GBP	500.000	Anglian Water Osprey Financing plc 5.00% 30/04/2023	612.024	0,60		
EUR	200.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.25% 31/03/2023	196.785	0,19	EUR	240.000	Anglo American Capital plc 3.25% 03/04/2023	252.402	0,25		
EUR	237.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 3.25% 15/04/2022	238.330	0,23	GBP	779.000	Arqiva Broadcast Finance plc 6.75% 30/09/2023	925.128	0,91		
EUR	1.090.000	United Group BV 4.88% 01/07/2024	1.105.324	1,08	GBP	406.000	Boparan Finance plc 7.63% 30/11/2025	418.212	0,41		
<b>Total de Países Bajos</b>				<b>7.546.117</b>	<b>7,35</b>	GBP	124.000	Co-operative Group FRN 08/07/2026	173.248	0,17	
<b>PANAMÁ</b>				<b>REINO UNIDO</b>							
EUR	200.000	Carnival Corp. 7.63% 01/03/2026	216.724	0,21	GBP	1.200.000	Co-Operative Group Limited 5.13% 17/05/2024	1.489.189	1,46		
<b>Total de Panamá</b>				<b>216.724</b>	<b>0,21</b>	EUR	817.000	EC Finance plc 2.38% 15/11/2022	821.520	0,80	
				<b>REINO UNIDO</b>							
				EUR				289.000	EC Finance plc 3.00% 15/10/2026	291.320	0,28
				EUR				862.000	EG Global Finance plc 3.63% 07/02/2024	857.544	0,84
				USD				189.923	Enquest plc 7.00% 15/04/2022	158.242	0,15
				GBP				580.000	GKN Holdings plc 5.38% 19/09/2022	701.130	0,68
				GBP				350.000	Heathrow Finance plc 5.25% 01/03/2024	426.784	0,42

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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>REINO UNIDO (continuación)</b>				<b>ESTADOS UNIDOS</b>					
GBP	366.000	Iceland Bondco plc 4.63% 15/03/2025	397.677	0,39	EUR	830.000	Avantor Funding Inc. 2.63% 01/11/2025	850.337	0,83
EUR	461.000	Ineos Quattro Finance 1 plc 3.75% 15/07/2026	474.695	0,46	EUR	290.000	Ball Corp. 0.88% 15/03/2024	292.925	0,29
EUR	394.000	Ineos Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	398.550	0,39	EUR	515.000	Ball Corp. 4.38% 15/12/2023	562.343	0,55
GBP	229.000	Inspired Entertainment Financing plc 7.88% 01/06/2026	274.419	0,27	EUR	404.000	Coty Inc. 4.00% 15/04/2023	407.447	0,40
EUR	1.083.000	International Game Technology plc 3.50% 15/07/2024	1.140.294	1,11	EUR	200.000	Ford Motor Credit Company LLC 1.51% 17/02/2023	202.399	0,20
GBP	934.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 3.88% 01/03/2023	1.099.956	1,06	GBP	391.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.75% 14/06/2024	460.434	0,45
GBP	241.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 5.00% 15/02/2022	283.930	0,28	EUR	394.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.02% 06/03/2024	411.504	0,40
EUR	140.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 5.88% 15/11/2024	149.667	0,15	EUR	123.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.25% 15/09/2025	131.295	0,13
GBP	736.300	Ladbrokes Group Finance plc 5.13% 16/09/2022	893.486	0,87	GBP	470.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.54% 06/03/2025	583.412	0,57
GBP	235.000	Ladbrokes Group Finance plc 5.13% 08/09/2023	291.088	0,28	EUR	464.000	Iqvia Inc. 1.75% 15/03/2026	471.050	0,46
GBP	841.000	Marks & Spencer plc 4.25% 08/12/2023	1.032.147	1,00	EUR	722.000	Kraft Heinz Foods Company 2.00% 30/06/2023	744.101	0,72
GBP	674.000	Marks & Spencer plc 6.13% 06/12/2021	793.111	0,77	GBP	977.000	MPT Operating Partnership LP 2.55% 05/12/2023	1.167.820	1,14
EUR	204.000	Modulaire Global Finance plc FRN 15/02/2023	205.214	0,20	EUR	700.000	MPT Operating Partnership LP 4.00% 19/08/2022	718.156	0,70
EUR	200.000	Modulaire Global Finance plc 6.50% 15/02/2023	203.778	0,20	EUR	1.004.000	Netflix Inc. 3.00% 15/06/2025	1.092.351	1,06
GBP	500.000	Ocado Group plc 4.00% 15/06/2024	587.677	0,57	EUR	300.000	Scientific Games International Inc. 3.38% 15/02/2026	303.321	0,30
EUR	594.000	OTE plc 2.38% 18/07/2022	605.810	0,59	EUR	131.000	Scientific Games International Inc. 5.50% 15/02/2026	135.440	0,13
EUR	204.000	Pinnacle Bidco plc 5.50% 15/02/2025	210.321	0,20	EUR	1.979.000	Silgan Holdings Inc. 3.25% 15/03/2025	1.996.793	1,95
GBP	400.000	Pinnacle Bidco plc 6.38% 15/02/2025	475.688	0,47	EUR	1.000.000	ZF North America Capital 2.75% 27/04/2023	1.036.130	1,01
GBP	271.000	Premier Foods Finance plc 3.50% 15/10/2026	318.254	0,31	<b>Total de Estados Unidos</b>			<b>11.567.258</b>	<b>11,29</b>
GBP	369.000	Punch Finance plc 6.13% 30/06/2026	440.233	0,43	<b>Total de bonos</b>			<b>95.317.654</b>	<b>92,87</b>
EUR	400.000	Synthomer plc 3.88% 01/07/2025	414.674	0,40	<b>Bonos - convertibles</b>				
GBP	1.393.000	Travis Perkins plc 4.50% 07/09/2023	1.722.210	1,68	<b>FRANCIA</b>				
EUR	875.000	Victoria plc 3.63% 26/08/2026	897.098	0,88	EUR	10.988	Elis SA 0.00% 06/10/2023	346.424	0,34
GBP	651.000	William Hill plc 4.88% 07/09/2023	799.417	0,78	<b>Total de Francia</b>			<b>346.424</b>	<b>0,34</b>
GBP	128.000	WM Morrison Supermarkets plc 4.63% 08/12/2023	158.138	0,15					
<b>Total del Reino Unido</b>		<b>21.394.275</b>	<b>20,86</b>						

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				
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario (continuación)</b>							
<b>Bonos - convertibles (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>							
<b>ITALIA</b>				<b>REINO UNIDO (continuación)</b>							
EUR	300.000	Telecom Italia SpA 1.13% 26/03/2022	300.837	0,29	GBP	755.000	Talktalk Telecom Group plc 3.88% 20/02/2025	862.999	0,84		
<b>Total de Italia</b>			<b>300.837</b>	<b>0,29</b>	<b>Total del Reino Unido</b>			<b>1.471.200</b>	<b>1,43</b>		
<b>Total de bonos - convertibles</b>				<b>647.261</b>	<b>0,63</b>	<b>Total de bonos</b>				<b>1.471.200</b>	<b>1,43</b>
<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>95.964.915</b>	<b>93,50</b>	<b>Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario</b>				<b>1.471.200</b>	<b>1,43</b>
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente</b>				<b>Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>							
<b>Bonos</b>				<b>Fondos</b>							
<b>REINO UNIDO</b>				<b>IRLANDA</b>							
GBP	620.000	Bellis Acquisition Company 3.25% 16/02/2026	710.774	0,69	6.801	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	670.347	0,65			
GBP	1.450.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	1.712.559	1,67	<b>Total de Irlanda</b>			<b>670.347</b>	<b>0,65</b>		
<b>Total del Reino Unido</b>			<b>2.423.333</b>	<b>2,36</b>	<b>Total de fondos</b>				<b>670.347</b>	<b>0,65</b>	
<b>ESTADOS UNIDOS</b>				<b>Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>				<b>670.347</b>	<b>0,65</b>		
USD	76.000	Adient USA LLC 9.00% 15/04/2025	71.127	0,07	<b>Valor total de las inversiones</b>				<b>100.600.922</b>	<b>98,01</b>	
<b>Total de Estados Unidos</b>			<b>71.127</b>	<b>0,07</b>	<b>(Coste total: 99.820.067 EUR)</b>						
<b>Total de bonos</b>				<b>2.494.460</b>	<b>2,43</b>						
<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente</b>				<b>2.494.460</b>	<b>2,43</b>						
<b>Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario</b>											
<b>Bonos</b>											
<b>REINO UNIDO</b>											
GBP	340.000	Miller Homes Group Holdings plc 5.50% 15/10/2024	401.367	0,39							
EUR	203.000	Modulaire Global Finance plc 6.50% 15/02/2023	206.834	0,20							

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## Threadneedle (Lux) - European Social Bond

### Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2021

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo			
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>						
<b>Bonos</b>				<b>Bonos (continuación)</b>						
<b>AUSTRALIA</b>				<b>FINLANDIA (continuación)</b>						
EUR	111.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031	110.784	0,03	EUR	500.000	OP Corporate Bank plc 0.60% 18/01/2027	508.832	0,13	
<b>Total de Australia</b>			<b>110.784</b>	<b>0,03</b>	<b>Total de Finlandia</b>			<b>2.530.674</b>	<b>0,65</b>	
<b>AUSTRIA</b>				<b>FRANCIA</b>						
EUR	800.000	Erste Group Bank AG 0.13% 17/05/2028	792.347	0,20	EUR	3.100.000	Action Logement SE 0.50% 30/10/2034	3.057.969	0,79	
EUR	1.800.000	Telekom Finanzmanagement GmbH 1.50% 07/12/2026	1.931.562	0,50	EUR	1.300.000	Air Liquide Finance SA 0.38% 27/05/2031	1.312.722	0,34	
EUR	600.000	Telekom Finanzmanagement GmbH 3.50% 04/07/2023	639.733	0,16	EUR	2.900.000	AXA SA FRN 07/10/2041	2.900.430	0,76	
<b>Total de Austria</b>			<b>3.363.642</b>	<b>0,86</b>	EUR	2.600.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.10% 08/10/2027	2.586.545	0,67	
<b>BÉLGICA</b>				EUR 600.000 Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.25% 29/06/2028				598.600	0,15	
EUR	500.000	Belfius Bank SA 0.01% 15/10/2025	500.526	0,13	EUR	300.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.63% 21/02/2031	297.000	0,08	
EUR	600.000	Belfius Bank SA 0.38% 08/06/2027	597.857	0,15	EUR	2.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.88% 18/06/2029	2.163.687	0,56	
EUR	700.000	Bpost SA 1.25% 11/07/2026	740.285	0,19	EUR	2.200.000	BNP Paribas 1.00% 17/04/2024	2.267.605	0,58	
EUR	1.200.000	KBC Group NV FRN 16/06/2027	1.212.598	0,31	EUR	1.200.000	BNP Paribas SA FRN 14/10/2027	1.204.105	0,31	
EUR	1.600.000	KBC Group NV 0.88% 27/06/2023	1.634.752	0,42	EUR	800.000	Bpce SA 0.13% 04/12/2024	808.279	0,21	
<b>Total de Bélgica</b>			<b>4.686.018</b>	<b>1,20</b>	EUR	3.600.000	BPCE SA 0.63% 26/09/2023	3.669.973	0,95	
<b>DINAMARCA</b>				EUR 2.500.000 BPCE SA 2.88% 22/04/2026				2.791.859	0,72	
EUR	1.200.000	Nykredit Realkredit A/S 0.75% 20/01/2027	1.224.940	0,32	EUR	2.400.000	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0.00% 25/11/2026	2.433.259	0,64	
EUR	600.000	Nykredit Realkredit A/S 0.88% 17/01/2024	614.411	0,16	EUR	1.200.000	Caisse des Depots et Consignations 0.01% 15/09/2025	1.219.081	0,31	
EUR	550.000	Nykredit Realkredit AS 0.38% 17/01/2028	543.186	0,14	EUR	800.000	Caisse des Depots et Consignations 0.01% 01/06/2026	812.781	0,21	
EUR	1.200.000	Nykredit Realkredit AS FRN 28/07/2031	1.204.367	0,31	EUR	3.100.000	Carrefour SA 2.63% 15/12/2027	3.539.304	0,91	
EUR	1.300.000	Orsted AS FRN 09/12/3019	1.341.872	0,35	EUR	1.200.000	CNP Assurances FRN 27/07/2050	1.254.908	0,32	
GBP	1.100.000	Orsted AS 2.13% 17/05/2027	1.338.105	0,34	USD	1.600.000	CNP Assurances Perp FRN	1.452.944	0,37	
EUR	700.000	Orsted AS FRN 24/11/3017	735.139	0,19	EUR	900.000	Credit Agricole Assurances SA Perp FRN	997.250	0,26	
GBP	900.000	Orsted AS 2.50% 16/05/2033	1.126.268	0,29	EUR	8.400.000	Credit Agricole SA 0.13% 09/12/2027	8.259.466	2,14	
<b>Total de Dinamarca</b>			<b>8.128.288</b>	<b>2,10</b>	EUR	800.000	Credit Agricole SA 0.50% 21/09/2029	794.283	0,20	
<b>FINLANDIA</b>				USD 1.300.000 Credit Agricole SA Perp FRN				1.252.804	0,32	
EUR	1.000.000	Elenia Finance Oyj 0.38% 06/02/2027	1.005.143	0,26	EUR	2.800.000	Credit Mutuel Arkea SA 0.38% 03/10/2028	2.811.152	0,72	
EUR	1.000.000	OP Corporate Bank plc 0.38% 26/02/2024	1.016.699	0,26	EUR	1.000.000	Credit Mutuel Arkea SA FRN 11/06/2029	1.043.861	0,27	
						EUR	4.300.000	Danone SA 1.00% 26/03/2025	4.460.324	1,15
						EUR	1.100.000	Faurecia 2.38% 15/06/2029	1.113.650	0,29
						EUR	675.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	700.541	0,18

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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>FRANCIA (continuación)</b>				<b>ALEMANIA (continuación)</b>					
EUR	300.000	Icade Sante SAS 0.88% 04/11/2029	303.897	0,08	EUR	600.000	Commerzbank AG 1.25% 23/10/2023	616.824	0,16
EUR	800.000	Ile-de-France Mobilites 0.40% 28/05/2031	805.969	0,21	EUR	750.000	Daimler AG 0.75% 10/09/2030	770.388	0,20
EUR	3.400.000	La Banque Postale SA 0.75% 23/06/2031	3.364.363	0,87	EUR	250.000	Daimler AG 0.75% 10/09/2030	256.796	0,07
EUR	500.000	La Banque Postale SA FRN 02/08/2032	494.150	0,13	EUR	100.000	Deutsche Apotheker- und Aerztebank 0.15% 07/03/2023	100.935	0,03
EUR	600.000	La Banque Postale SA Perp FRN	634.816	0,16	EUR	1.500.000	Deutsche Bahn Finance GmbH 0.35% 29/09/2031	1.492.537	0,38
EUR	800.000	La Poste SA 1.38% 21/04/2032	862.014	0,22	EUR	800.000	Deutsche Bahn Finance GmbH 0.63% 08/12/2050	695.325	0,18
EUR	4.600.000	Orange SA 0.13% 16/09/2029	4.545.511	1,16	EUR	300.000	Deutsche Bahn Finance GmbH 1.63% 16/08/2033	334.066	0,09
EUR	1.200.000	Orange SA Perp FRN	1.336.960	0,34	GBP	600.000	Deutsche Bahn Finance GmbH 1.88% 13/02/2026	725.681	0,19
EUR	700.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	714.530	0,18	USD	2.400.000	Deutsche Bank 1.69% 19/03/2026	2.084.617	0,54
EUR	800.000	RATP 0.88% 25/05/2027	842.900	0,22	EUR	2.300.000	Deutsche Bank AG FRN 10/06/2026	2.413.042	0,62
EUR	1.000.000	RTE Réseau de Transport d'Electricite SADIR 1.88% 23/10/2037	1.141.355	0,29	EUR	425.000	Deutsche Kreditbank AG 0.01% 07/11/2029	424.611	0,11
EUR	2.800.000	Sanofi 1.50% 01/04/2030	3.095.372	0,80	EUR	600.000	Deutsche Kreditbank AG 0.88% 02/10/2028	639.084	0,16
EUR	1.100.000	Schneider Electric SE 1.84% 13/10/2025	1.193.067	0,31	EUR	1.985.000	E.On SE 0.60% 01/10/2032	1.967.332	0,51
EUR	300.000	SNCF Réseau 0.88% 22/01/2029	317.302	0,08	EUR	2.600.000	E.ON SE 0.35% 28/02/2030	2.576.260	0,66
EUR	300.000	SNCF Réseau 2.25% 20/12/2047	377.093	0,10	EUR	515.000	E.ON SE 0.60% 01/10/2032	510.416	0,13
EUR	1.600.000	SNCF SA 0.63% 17/04/2030	1.650.927	0,42	EUR	3.200.000	Eurogrid GmbH 1.11% 15/05/2032	3.365.088	0,86
EUR	300.000	Societe du Grand Paris EPIC 0.88% 10/05/2046	296.644	0,08	EUR	1.200.000	Eurogrid GmbH 1.63% 03/11/2023	1.242.270	0,32
EUR	2.500.000	Societe Generale SA FRN 22/09/2028	2.541.353	0,65	EUR	300.000	Hamburger Hochbahn AG 0.13% 24/02/2031	296.004	0,08
EUR	1.200.000	Unedic Asseo 0.25% 25/11/2029	1.219.855	0,31	EUR	600.000	Hamburger Hochbahn AG 0.13% 24/02/2031	592.007	0,15
EUR	950.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.00% 14/03/2025	989.452	0,25	EUR	400.000	Landeskreditbank Baden- Wuerttemberg Foerderbank 0.38% 30/09/2027	404.532	0,10
EUR	1.000.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE Perp FRN	1.020.708	0,26	EUR	1.000.000	LB Baden-Wuerttember 0.38% 21/02/2031	981.036	0,25
		<b>Total de Francia</b>	<b>83.552.620</b>	<b>21,53</b>	EUR	2.800.000	Muenchener Rueckversicherungs- Gesellschaft AG FRN 26/05/2041	2.825.480	0,73
<b>ALEMANIA</b>					EUR	1.000.000	NRW Bank 0.10% 09/07/2035	962.061	0,25
EUR	700.000	Allianz SE FRN 08/07/2050	749.561	0,19	EUR	1.900.000	O2 Telefonica Deutschland Finanzierungs GmbH 1.75% 05/07/2025	2.009.747	0,52
EUR	1.000.000	Allianz SE FRN 08/07/2050	1.070.801	0,28	EUR	500.000	Vantage Towers AG 0.38% 31/03/2027	500.055	0,13
EUR	1.000.000	Amprion GmbH 0.63% 23/09/2033	978.100	0,25	EUR	100.000	Vantage Towers AG 0.38% 31/03/2027	100.011	0,03
EUR	900.000	Bayerische Landesbode 0.25% 21/03/2036	883.728	0,23					
EUR	950.000	Bayerische Landesbodenkreditanstalt 0.63% 22/11/2027	993.602	0,26					
EUR	2.200.000	Commerzbank AG FRN 24/03/2026	2.244.442	0,58					

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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>ALEMANIA (continuación)</b>				<b>ITALIA (continuación)</b>					
EUR	900.000	Vantage Towers AG 0.75% 31/03/2030	900.075	0,23	EUR	1.500.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale 0.38% 23/06/2029	1.503.267	0,39
EUR	400.000	Vier Gas Transport GmbH 0.13% 10/09/2029	391.615	0,10			<b>Total de Italia</b>	<b>15.557.270</b>	<b>4,02</b>
EUR	300.000	Vonovia SE 0.63% 14/12/2029	299.894	0,08					
EUR	1.000.000	Vonovia SE 0.63% 24/03/2031	994.909	0,25					
		<b>Total de Alemania</b>	<b>38.392.932</b>	<b>9,90</b>					
<b>IRLANDA</b>				<b>LUXEMBURGO</b>					
EUR	200.000	AIB Group plc FRN 17/11/2027	200.891	0,05	EUR	2.600.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 04/06/2026	2.714.372	0,70
EUR	1.900.000	AIB Group plc FRN 30/05/2031	2.041.331	0,53	EUR	649.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.34% 13/08/2041	625.487	0,16
EUR	1.000.000	Bank of Ireland Group FRN 10/05/2027	996.405	0,26	EUR	900.000	CPI Property Group SA 2.75% 12/05/2026	987.274	0,25
EUR	1.170.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	1.171.092	0,30	EUR	2.350.000	Holcim Finance Luxembourg SA 0.50% 23/04/2031	2.281.576	0,59
EUR	100.000	ESB Finance DAC 1.13% 11/06/2030	105.592	0,03	EUR	500.000	Prologis International Funding II SA 1.63% 17/06/2032	536.467	0,14
EUR	700.000	ESB Finance DAC 1.13% 11/06/2030	739.142	0,19	EUR	600.000	Prologis International Funding II SA 2.38% 14/11/2030	690.602	0,18
EUR	500.000	Lunar Funding V for Swisscom AG 1.13% 12/10/2026	527.679	0,14	EUR	253.000	Segro Capital Sarl 0.50% 22/09/2031	247.575	0,06
		<b>Total de Irlanda</b>	<b>5.782.132</b>	<b>1,50</b>			<b>Total de Luxemburgo</b>	<b>8.083.353</b>	<b>2,08</b>
<b>ITALIA</b>				<b>PAÍSES BAJOS</b>					
EUR	700.000	Aeroporti di Roma SpA 1.75% 30/07/2031	726.974	0,19	EUR	1.600.000	ABN Amro Bank NV 0.50% 15/04/2026	1.640.176	0,42
EUR	500.000	Aeroporti di Roma SpA 1.75% 30/07/2031	519.267	0,13	EUR	1.500.000	ABN Amro Bank NV 0.88% 22/04/2025	1.555.887	0,40
EUR	1.000.000	Assicurazioni Generali SpA 1.71% 30/06/2032	1.004.750	0,26	EUR	1.100.000	Achmea BV 1.50% 26/05/2027	1.174.715	0,30
EUR	1.500.000	Assicurazioni Generali SpA 2.12% 01/10/2030	1.598.440	0,41	EUR	1.400.000	Akelius Residential Property Financing BV 1.00% 17/01/2028	1.425.871	0,37
EUR	800.000	Banco BPM SpA 0.88% 15/07/2026	798.185	0,21	EUR	1.300.000	Allianz Finance II BV 1.50% 15/01/2030	1.440.044	0,37
EUR	500.000	ERG SpA 1.88% 11/04/2025	529.262	0,14	EUR	1.200.000	Cooperatieve Rabobank UA 0.25% 30/10/2026	1.213.957	0,31
EUR	1.200.000	Ferrovie dello Stato Italiane SpA 1.13% 09/07/2026	1.262.696	0,33	GBP	1.660.000	Cooperatieve Rabobank UA 4.63% 23/05/2029	2.263.796	0,58
EUR	900.000	Ferrovie dello Stato Italiane SpA 1.50% 27/06/2025	950.651	0,24	EUR	1.000.000	Cooperatieve Rabobank UA Perp FRN	1.030.449	0,27
EUR	2.200.000	Intesa Sanpaolo SpA 0.75% 04/12/2024	2.255.559	0,58	EUR	200.000	Cooperatieve Rabobank UA Perp FRN	222.501	0,06
EUR	1.068.000	Snam SpA 0.00% 15/08/2025	1.067.796	0,28	EUR	1.200.000	Cooperatieve Rabobank UA Perp FRN	1.335.008	0,34
EUR	1.500.000	Snam SpA 0.00% 07/12/2028	1.452.144	0,37	EUR	900.000	De Volksbank NV 0.38% 03/03/2028	890.048	0,23
EUR	900.000	Snam SpA 0.63% 30/06/2031	896.750	0,23	EUR	3.700.000	De Volksbank NV FRN 22/10/2030	3.885.035	1,00
EUR	300.000	Snam SpA 0.75% 17/06/2030	304.498	0,08	EUR	1.700.000	Digital Dutch Finco BV 0.63% 15/07/2025	1.733.401	0,46
EUR	700.000	Telecom Italia SpA 1.63% 18/01/2029	687.031	0,18					

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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>PAÍSES BAJOS (continuación)</b>				<b>PAÍSES BAJOS (continuación)</b>					
EUR	1.225.000	Digital Dutch Finco BV 1.50% 15/03/2030	1.287.666	0,33	EUR	7.000.000	Volkswagen International Finance NV 0.88% 22/09/2028	7.213.166	1,85
EUR	1.000.000	Digital Intrepid Holding BV 0.63% 15/07/2031	957.995	0,25			<b>Total de Países Bajos</b>	<b>56.886.875</b>	<b>14,65</b>
EUR	200.000	EnBW International Finance BV 1.88% 31/10/2033	228.656	0,06	<b>NORUEGA</b>				
EUR	2.700.000	Enel Finance International NV 1.50% 21/07/2025	2.853.061	0,73	EUR	200.000	Avinor AS 0.75% 01/10/2030	203.501	0,05
EUR	1.500.000	Enexis Holding NV 0.38% 14/04/2033	1.467.180	0,38	EUR	200.000	Avinor AS 0.75% 01/10/2030	203.501	0,05
EUR	879.000	Enexis Holding NV 0.63% 17/06/2032	892.233	0,23	EUR	1.617.000	Avinor AS 1.00% 29/04/2025	1.679.943	0,44
EUR	221.000	Enexis Holding NV 0.63% 17/06/2032	224.327	0,06	EUR	200.000	Avinor AS 1.25% 09/02/2027	212.466	0,05
EUR	1.000.000	Iberdrola International BV Perp FRN	1.005.489	0,26			<b>Total de Noruega</b>	<b>2.299.411</b>	<b>0,59</b>
EUR	500.000	Iberdrola International BV Perp FRN	511.254	0,13	<b>PORTUGAL</b>				
EUR	300.000	Iberdrola International BV Perp FRN	315.878	0,08	EUR	200.000	EDP - Energias de Portugal SA 1.63% 15/04/2027	214.452	0,06
EUR	500.000	Iberdrola International BV Perp FRN	541.631	0,14			<b>Total de Portugal</b>	<b>214.452</b>	<b>0,06</b>
GBP	2.200.000	ING Groep NV FRN 07/12/2028	2.488.123	0,64	<b>ESPAÑA</b>				
EUR	2.400.000	ING Groep NV 2.50% 15/11/2030	2.834.927	0,73	EUR	1.600.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 0.75% 04/06/2025	1.647.041	0,42
EUR	100.000	NE Property BV 3.38% 14/07/2027	112.896	0,03	EUR	1.000.000	Banco de Sabadell SA FRN 11/03/2027	1.028.974	0,27
EUR	600.000	NE Property BV 3.38% 14/07/2027	677.377	0,17	EUR	1.300.000	Banco Santander SA 0.30% 04/10/2026	1.311.631	0,34
EUR	400.000	NederFinMaat 0.13% 03/04/2027	405.057	0,10	EUR	1.100.000	Banco Santander SA 1.13% 23/06/2027	1.145.966	0,30
EUR	700.000	Royal Schiphol Group NV 1.50% 05/11/2030	764.609	0,20	EUR	300.000	Caixabank SA FRN 18/06/2031	303.892	0,08
EUR	300.000	Royal Schiphol Group NV 2.00% 06/04/2029	335.728	0,09	EUR	1.500.000	CaixaBank SA 0.63% 01/10/2024	1.527.447	0,39
EUR	3.400.000	Stedin Holding NV 0.50% 14/11/2029	3.440.686	0,88	EUR	2.400.000	CaixaBank SA FRN 10/07/2026	2.456.474	0,63
EUR	364.000	Stedin Holding NV Perp FRN	370.878	0,10	EUR	1.400.000	CaixaBank SA FRN 26/05/2028	1.414.354	0,36
EUR	2.000.000	Swisscom Finance BV 0.38% 14/11/2028	2.027.690	0,52	GBP	200.000	CaixaBank SA FRN 03/12/2026	232.375	0,06
EUR	600.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	585.372	0,15	EUR	1.500.000	Iberdrola Finanzas SA 1.25% 28/10/2026	1.593.925	0,41
EUR	100.000	Telefonica Europe BV Perp 2.38%	97.562	0,03	EUR	500.000	Red Electrica Financiaciones SAU 0.38% 24/07/2028	508.506	0,13
EUR	900.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	921.421	0,24	EUR	1.100.000	Telefonica Emisiones SA 1.07% 05/02/2024	1.130.527	0,29
EUR	1.500.000	Tennet Holding BV 0.50% 30/11/2040	1.360.487	0,35	GBP	200.000	Telefonica Emisiones SA 5.45% 08/10/2029	292.237	0,08
EUR	1.969.000	Tennet Holding BV Perp FRN	2.079.306	0,53			<b>Total de España</b>	<b>14.593.349</b>	<b>3,76</b>
EUR	550.000	Vesteda Finance BV 1.50% 24/05/2027	587.095	0,15	<b>SUECIA</b>				
EUR	450.000	Vesteda Finance BV 2.00% 10/07/2026	488.237	0,13	EUR	1.200.000	Essity AB 0.63% 28/03/2022	1.203.021	0,31
					EUR	1.500.000	Essity AB 1.13% 27/03/2024	1.544.989	0,40
					EUR	450.000	Nordea Bank AB 0.30% 30/06/2022	452.808	0,12

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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>SUECIA (continuación)</b>				<b>REINO UNIDO (continuación)</b>					
EUR	900.000	Svenska Handelsbanken AB 0.01% 02/12/2027	887.323	0,23	GBP	300.000	Legal & General Group plc FRN 27/10/2045	397.759	0,10
EUR	100.000	Volvo Car AB 2.50% 07/10/2027	109.212	0,03	EUR	2.000.000	Motability Operations Group plc 0.13% 20/07/2028	1.983.373	0,51
EUR	100.000	Volvo Car AB 2.50% 07/10/2027	109.212	0,03	EUR	750.000	Motability Operations Group plc 0.38% 03/01/2026	762.860	0,20
	<b>Total de Suecia</b>	<b>4.306.565</b>	<b>1,12</b>	GBP	490.000	Motability Operations Group plc 1.50% 20/01/2041	513.312	0,13	
<b>SUIZA</b>				EUR	1.500.000	National Grid Electricity Transmission plc 0.19% 20/01/2025	1.511.076	0,39	
EUR	1.000.000	Credit Suisse AG 0.45% 19/05/2025	1.014.656	0,26	GBP	200.000	Nationwide Building Society Perp FRN	258.779	0,07
	<b>Total de Suiza</b>	<b>1.014.656</b>	<b>0,26</b>	GBP	300.000	Nationwide Building Society Perp FRN	380.951	0,09	
<b>REINO UNIDO</b>				EUR	3.080.000	Natwest Group plc FRN 26/02/2030	3.079.893	0,79	
GBP	1.500.000	Anglian Water Services Financing plc 1.63% 10/08/2025	1.791.273	0,46	EUR	300.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	305.970	0,08
GBP	600.000	Aster Treasury plc 1.41% 27/01/2036	650.076	0,17	GBP	200.000	Orbit Capital plc 2.00% 24/11/2038	226.325	0,06
EUR	700.000	AstraZeneca plc 0.38% 03/06/2029	700.375	0,18	GBP	500.000	Paragon Treasury plc 2.00% 07/05/2036	575.801	0,15
GBP	200.000	Blend Funding plc 2.92% 05/04/2054	261.388	0,07	GBP	1.000.000	Pearson Funding plc 3.75% 04/06/2030	1.284.024	0,33
GBP	200.000	Blend Funding plc 3.46% 21/09/2049	284.203	0,07	GBP	450.000	Platform HG Financing plc 1.93% 15/09/2041	500.879	0,13
GBP	100.000	British Telecommunications plc 3.13% 21/11/2031	120.894	0,03	EUR	1.100.000	Rentokil Initial plc 0.50% 14/10/2028	1.106.035	0,29
GBP	100.000	BUPA Finance plc 1.75% 14/06/2027	118.497	0,03	GBP	43.000	Retail Charity Bonds plc 5.00% 12/04/2026	56.435	0,01
GBP	600.000	BUPA Finance plc 5.00% 08/12/2026	810.555	0,21	GBP	900.000	RI Finance FRN 30/11/2043	1.148.895	0,30
EUR	875.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	875.130	0,23	GBP	625.000	RI Finance Bonds No 4 plc FRN 07/10/2049	820.888	0,21
EUR	250.000	Cadent Finance plc 0.75% 11/03/2032	247.930	0,06	GBP	800.000	Severn Trent Utilities Finance plc 2.00% 02/06/2040	897.916	0,23
GBP	300.000	Cardiff University 3.00% 07/12/2055	424.702	0,12	GBP	1.100.000	Stonewater Funding plc 1.63% 10/09/2036	1.213.145	0,31
GBP	630.000	Ds Smith plc 2.88% 26/07/2029	765.151	0,20	GBP	200.000	Thames Water Utilities Finance plc 1.88% 24/01/2024	237.646	0,06
GBP	1.000.000	Dwr Cymru Financing UK plc 1.63% 31/03/2026	1.176.906	0,30	GBP	1.000.000	Thames Water Utilities Finance plc 2.38% 22/04/2040	1.150.918	0,30
GBP	400.000	DWR Cymru Financing UK plc 2.38% 31/03/2034	468.590	0,12	GBP	1.100.000	United Utilities Water Finance plc 0.88% 28/10/2029	1.213.810	0,32
GBP	245.000	GlaxoSmithKline Capital plc 1.25% 12/10/2028	282.001	0,07	GBP	325.000	University College London 1.63% 04/06/2061	367.668	0,09
GBP	255.000	GlaxoSmithKline Capital plc 1.25% 12/10/2028	293.511	0,08	GBP	300.000	University of Southampton 2.25% 11/04/2057	360.446	0,09
GBP	100.000	Guinness Partnership Limited 2.00% 22/04/2055	114.470	0,03	USD	1.000.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	949.932	0,24
USD	1.500.000	HSBC Holdings plc FRN 22/11/2023	1.331.232	0,34					

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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)</b>					
<b>REINO UNIDO (continuación)</b>				<b>FINLANDIA</b>					
GBP	900.000	Wellcome Trust Finance plc 4.63% 25/07/2036	1.467.856	0,37	EUR	1.700.000	Kuntarahoitus Oyj 0.05% 10/09/2035	1.630.221	0,43
EUR	4.375.000	Wellcome Trust Limited 1.13% 21/01/2027	4.651.162	1,20	<b>Total de Finlandia</b>				
GBP	100.000	Wellcome Trust Limited 1.50% 14/07/2071	105.604	0,03	<b>1.630.221 0,43</b>				
<b>Total del Reino Unido</b>				<b>38.246.242 9,85</b>					
<b>ESTADOS UNIDOS</b>				<b>FRANCIA</b>					
USD	225.000	Astrazeneca Finance LLC 2.25% 28/05/2031	197.519	0,05	EUR	300.000	Agence Francaise de Developpement EPIC 0.50% 31/10/2025	310.350	0,08
EUR	1.100.000	Becton Dickinson and Company 1.40% 24/05/2023	1.128.036	0,29	EUR	500.000	Bpifrance Financement SA 0.13% 26/02/2027	509.558	0,13
USD	900.000	Becton Dickinson and Company 2.82% 20/05/2030	813.769	0,21	EUR	1.300.000	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0.00% 25/02/2028	1.310.887	0,34
GBP	100.000	Becton Dickinson and Company 3.02% 24/05/2025	123.564	0,03	EUR	1.400.000	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0.00% 25/11/2030	1.380.382	0,36
EUR	900.000	Digital Euro Finco LLC 2.50% 16/01/2026	983.210	0,25	GBP	1.200.000	Caisse D'amortissement de la Dette Sociale 0.13% 15/12/2025	1.359.222	0,35
EUR	2.000.000	Prologis Euro Finance LLC 0.38% 06/02/2028	2.014.595	0,52	EUR	300.000	Caisse Francaise de Financement Local 0.01% 07/05/2025	303.446	0,08
USD	2.600.000	Roche Holdings Inc. 2.38% 28/01/2027	2.348.612	0,60	EUR	1.100.000	Caisse Francaise de Financement Local 0.50% 19/02/2027	1.139.135	0,29
<b>Total de Estados Unidos</b>				<b>7.609.305 1,95</b>					
<b>Total de bonos</b>				<b>295.358.568 76,11</b>					
<b>Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda</b>				<b>Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)</b>					
<b>AUSTRIA</b>				<b>FRANCIA</b>					
EUR	700.000	Oesterreichische Kontrollbank AG 0.00% 08/10/2026	706.493	0,18	EUR	5.000	France (Govt of) OAT 1.75% 25/06/2039	6.055	0,00
<b>Total de Austria</b>				<b>706.493 0,18</b>					
<b>BÉLGICA</b>				<b>FRANCIA</b>					
EUR	100.000	Belgium (Govt of) 1.25% 22/04/2033	112.468	0,03	EUR	700.000	Ile de France (Region of) 0.50% 14/06/2025	721.457	0,19
EUR	1.500.000	Communaute Francaise de Belgique 0.63% 11/06/2035	1.507.388	0,39	EUR	1.200.000	Region of Ile de France 0.00% 20/04/2028	1.203.966	0,31
EUR	1.400.000	Ministeries Van de Vlaamse Gemeenschap 0.38% 15/04/2030	1.430.534	0,37	EUR	400.000	Region of Ile de France 0.61% 02/07/2040	384.849	0,10
EUR	1.800.000	Region Wallonne Belgium 1.05% 22/06/2040	1.836.622	0,47	EUR	700.000	SNCF SA 1.00% 19/01/2061	591.147	0,15
<b>Total de Bélgica</b>				<b>4.887.012 1,26</b>					
				<b>ALEMANIA</b>					
				EUR 5.000 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.00% 15/08/2030				5.156	0,00
				<b>Total de Francia</b>				<b>17.948.260</b>	<b>4,63</b>

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			
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>						
<b>Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)</b>				<b>Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)</b>						
<b>ALEMANIA (continuación)</b>				<b>LUXEMBURGO</b>						
EUR	200.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.00% 15/08/2050	186.792	0,05	EUR	1.200.000	Luxembourg (Govt of) 0.00% 14/09/2032	1.187.842	0,31	
EUR	300.000	Free and Hanseatic City of Hamburg 0.30% 16/09/2050	275.622	0,07	<b>Total de Luxemburgo</b>					
EUR	140.000	Land Berlin 0.35% 09/09/2050	130.704	0,03	<b>1.187.842 0,31</b>					
EUR	3.300.000	Landwirtschaftliche Rentenbank 0.00% 22/09/2027	3.347.336	0,86	<b>PAÍSES BAJOS</b>					
EUR	600.000	State of Hesse 0.01% 18/06/2031	596.015	0,15	EUR	1.000.000	Bank Nederlandse Gemeenten NV 0.05% 13/07/2024	1.013.587	0,26	
EUR	1.400.000	State of North Rhine-Westphalia Germany 0.60% 04/06/2041	1.414.655	0,36	EUR	600.000	Nederlandse Waterschapsbank NV 0.13% 03/09/2035	579.020	0,15	
EUR	700.000	State of North Rhine-Westphalia Germany 0.95% 13/03/2028	749.891	0,19	EUR	650.000	Nederlandse Waterschapsbank NV 1.50% 15/06/2039	761.119	0,20	
<b>Total de Alemania</b>				<b>6.706.171</b>	<b>1,71</b>	EUR	30.000	Netherlands (Govt of) 0.50% 15/01/2040	31.668	0,01
						<b>Total de Paises Bajos</b>				
						<b>2.385.394 0,62</b>				
<b>HUNGRÍA</b>				<b>POLONIA</b>						
EUR	250.000	MFB Magyar Fejlesztési Bank Zrt 1.38% 24/06/2025	261.896	0,07	EUR	1.250.000	Poland (Govt of) 1.13% 07/08/2026	1.332.969	0,34	
<b>Total de Hungría</b>				<b>261.896</b>	<b>0,07</b>	<b>Total de Polonia</b>				
						<b>1.332.969 0,34</b>				
<b>IRLANDA</b>				<b>ESPAÑA</b>						
EUR	100.000	Ireland (Govt of) 1.35% 18/03/2031	112.048	0,03	EUR	1.100.000	Autonomous Community of Andalusia 0.50% 30/04/2031	1.093.329	0,28	
GBP	200.000	NIE Finance plc 6.38% 02/06/2026	286.918	0,07	EUR	1.400.000	Autonomous Community of Madrid 0.42% 30/04/2030	1.411.968	0,36	
<b>Total de Irlanda</b>				<b>398.966</b>	<b>0,10</b>	EUR	3.809.000	Autonomous Community of Madrid 1.57% 30/04/2029	4.194.975	1,09
						EUR	200.000	Basque (Govt of) 0.25% 30/04/2031	197.405	0,05
<b>ITALIA</b>				<b>EUROPA</b>						
EUR	1.700.000	Cassa Depositi e Prestiti SpA 0.75% 21/11/2022	1.722.002	0,44	EUR	700.000	Instituto de Credito Oficial 0.25% 30/04/2024	713.393	0,18	
EUR	800.000	Cassa Depositi e Prestiti SpA 1.00% 11/02/2030	814.681	0,21	EUR	2.600.000	Instituto de Credito Oficial 0.75% 31/10/2023	2.668.750	0,68	
EUR	1.200.000	Cassa Depositi e Prestiti SpA 1.50% 20/04/2023	1.234.206	0,32	EUR	200.000	Spain (Govt of) 1.00% 30/07/2042	197.432	0,06	
EUR	500.000	Cassa Depositi e Prestiti SpA 2.00% 20/04/2027	545.445	0,14	EUR	200.000	Xunta de Galicia 0.08% 30/07/2027	200.628	0,05	
EUR	2.100.000	Cassa Depositi e Prestiti SpA 2.13% 21/03/2026	2.288.579	0,59	<b>Total de España</b>					
EUR	200.000	Italy (Govt of) BPT 1.50% 30/04/2045	194.884	0,05	<b>10.677.880 2,75</b>					
<b>Total de Italia</b>				<b>6.799.797</b>	<b>1,75</b>	<b>SUPRANACIONAL</b>				
						EUR	2.200.000	African Development Bank 0.25% 21/11/2024	2.243.622	0,58
						USD	350.000	African Development Bank 0.75% 03/04/2023	304.538	0,08
						EUR	1.450.000	Council of Europe 0.38% 27/03/2025	1.491.478	0,38

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			
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>						
<b>Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)</b>				<b>Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)</b>						
<b>SUPRANACIONAL (continuación)</b>				<b>REINO UNIDO</b>						
EUR	1.800.000	Council of Europe Development Bank 0.00% 10/04/2026	1.830.006	0,47	USD	4.375.000	International Finance Facility for Immunisation Company 0.38% 06/11/2023	3.771.434	0,98	
EUR	3.400.000	Council Of Europe Development Bank 0.00% 09/04/2027	3.450.113	0,90	USD	1.600.000	International Finance Facility for Immunisation Company 1.00% 21/04/2026	1.375.169	0,35	
EUR	600.000	Eurofima 0.50% 23/04/2041	581.836	0,15	GBP	50.000	United Kingdom Gilt 0.88% 31/07/2033	56.766	0,01	
EUR	3.000.000	European Investment Bank 0.00% 15/05/2028	3.045.709	0,78	<b>Total del Reino Unido</b>			<b>5.203.369</b>	<b>1,34</b>	
EUR	2.250.000	European Union 0.00% 02/06/2028	2.284.390	0,59	<b>Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda</b>				<b>82.796.396</b>	<b>21,34</b>
EUR	800.000	European Union 0.00% 04/07/2035	770.114	0,20	<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>378.154.964</b>	<b>97,45</b>
EUR	1.100.000	European Union 0.10% 04/10/2040	1.028.661	0,27	<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente</b>					
EUR	2.200.000	European Union 0.30% 04/11/2050	2.038.151	0,53	<b>Bonos</b>					
EUR	200.000	IBRD 0.20% 21/01/2061	167.592	0,04	<b>FRANCIA</b>					
GBP	250.000	Inter-American Development Bank 0.50% 15/09/2026	286.585	0,07	USD	700.000	Credit Agricole 2.81% 11/01/2041	576.403	0,15	
USD	237.000	Inter-American Investment Corp. 0.50% 21/07/2023	205.111	0,05	<b>Total de Francia</b>			<b>576.403</b>	<b>0,15</b>	
USD	200.000	Inter-American Investment Corp. 0.75% 04/05/2022	173.122	0,04	<b>PAÍSES BAJOS</b>					
EUR	500.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.01% 24/04/2028	504.451	0,13	USD	550.000	Cooperatieve Rabobank UA 1.00% 24/09/2026	468.230	0,12	
USD	600.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.63% 22/04/2025	516.634	0,13	<b>Total de Países Bajos</b>			<b>468.230</b>	<b>0,12</b>	
USD	210.000	International Bank for Reconstruction & Development 1.13% 13/09/2028	178.147	0,05	<b>Total de bonos</b>				<b>1.044.633</b>	<b>0,27</b>
EUR	250.000	International Development Association 0.35% 22/04/2036	247.214	0,06	<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente</b>				<b>1.044.633</b>	<b>0,27</b>
USD	600.000	International Finance Corp. 0.50% 20/03/2023	519.525	0,13						
EUR	410.000	Nordic Investment Bank 0.00% 06/04/2023	413.789	0,11						
SEK	3.000.000	Nordic Investment Bank 0.10% 13/10/2025	292.135	0,08						
<b>Total de supranacional</b>			<b>22.572.923</b>	<b>5,82</b>						
<b>SUECIA</b>										
SEK	1.000.000	Sweden (Govt of) 0.13% 09/09/2030	97.203	0,03						
<b>Total de Suecia</b>			<b>97.203</b>	<b>0,03</b>						

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
<b>Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>			
<b>Fondos</b>			
<b>IRLANDA</b>			
50.577	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	4.985.161	1,28
	<b>Total de Irlanda</b>	<b>4.985.161</b>	<b>1,28</b>
	<b>Total de fondos</b>	<b>4.985.161</b>	<b>1,28</b>
	<b>Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>	<b>4.985.161</b>	<b>1,28</b>
	<b>Valor total de las inversiones</b>	<b>384.184.758</b>	<b>99,00</b>
<b>(Coste total: 384.823.697 EUR)</b>			

## Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

### Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2021

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo				
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>							
<b>Bonos</b>				<b>Bonos (continuación)</b>							
<b>AUSTRALIA</b>				<b>DINAMARCA</b>							
EUR	823.000	APT Pipelines Limited 1.25% 15/03/2033	818.659	0,37	EUR	752.000	Danske Bank AS FRN 09/06/2029	752.364	0,34		
EUR	935.000	APT Pipelines Limited 2.00% 15/07/2030	1.009.548	0,45	EUR	437.000	Danske Bank AS FRN 15/05/2031	439.094	0,20		
EUR	418.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031	417.185	0,19	EUR	863.000	Nykredit Realkredit AS 0.38% 17/01/2028	852.309	0,38		
GBP	840.000	Pacific National Finance Pty Limited 5.00% 19/09/2023	1.043.837	0,46	<b>Total de Dinamarca</b>			<b>2.043.767</b>	<b>0,92</b>		
<b>Total de Australia</b>				<b>3.289.229</b>	<b>1,47</b>	<b>FRANCIA</b>					
<b>BÉLGICA</b>				EUR				152.000	Altice France SA 3.38% 15/01/2028	146.846	0,07
EUR	619.000	Anheuser-Busch InBev SA/ NV 3.70% 02/04/2040	830.969	0,37	EUR	171.000	Altice France SA 4.00% 15/07/2029	169.090	0,08		
EUR	233.000	House of Finance NV 4.38% 15/07/2026	239.599	0,11	EUR	707.000	Altice France SA 4.25% 15/10/2029	699.943	0,31		
EUR	400.000	Kbc Group NV Perp FRN	423.756	0,19	EUR	592.000	CAB Selas 3.38% 01/02/2028	598.136	0,27		
<b>Total de Bélgica</b>				<b>1.494.324</b>	<b>0,67</b>	EUR	431.000	Casino Guichard Perrachon SA 5.25% 15/04/2027	434.446	0,19	
<b>BERMUDAS</b>				EUR				484.000	Casino Guichard Perrachon SA 6.63% 15/01/2026	506.163	0,23
EUR	3.052.000	Bacardi Limited 2.75% 03/07/2023	3.201.402	1,44	EUR	480.000	Chrome Holding SASU 5.00% 31/05/2029	493.257	0,22		
<b>Total de Bermudas</b>				<b>3.201.402</b>	<b>1,44</b>	EUR	1.112.000	Constellium SE 3.13% 15/07/2029	1.118.353	0,50	
<b>CANADÁ</b>				EUR				800.000	Credit Agricole SA 0.50% 21/09/2029	794.283	0,36
EUR	525.000	Primo Water Holdings Inc. 3.88% 31/10/2028	545.249	0,24	EUR	200.000	Electricite de France SA 2.00% 09/12/2049	212.543	0,10		
<b>Total de Canadá</b>				<b>545.249</b>	<b>0,24</b>	EUR	600.000	Electricite de France SA Perp FRN	610.026	0,27	
<b>ISLAS CAIMÁN</b>				EUR				600.000	Electricite de France SA Perp FRN	632.760	0,28
USD	1.089.000	Alibaba Group Holding Limited 4.00% 06/12/2037	1.022.816	0,46	EUR	431.000	Elior Group SA 3.75% 15/07/2026	447.139	0,20		
USD	800.000	Energuate Trust 5.88% 03/05/2027	719.306	0,32	EUR	409.000	Faurecia 2.38% 15/06/2029	414.075	0,19		
GBP	3.535.000	Southern Water Services Finance Limited 2.38% 28/05/2028	4.255.524	1,90	EUR	670.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2027	674.757	0,30		
USD	444.000	Tencent Holdings Limited 2.88% 22/04/2031	391.697	0,18	EUR	552.000	Foncia Management SASU 3.38% 31/03/2028	552.065	0,25		
USD	253.000	Tencent Holdings Limited 3.24% 03/06/2050	207.782	0,09	EUR	555.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	576.000	0,26		
USD	730.000	Tencent Holdings Limited 3.60% 19/01/2028	674.948	0,30	EUR	377.000	Iqera Group SAS 4.25% 30/09/2024	378.589	0,17		
EUR	460.000	UPCB Finance VII Limited 3.63% 15/06/2029	473.414	0,21	EUR	198.000	Iqera Group SAS 6.50% 30/09/2024	204.712	0,09		
<b>Total de Islas Caimán</b>				<b>7.745.487</b>	<b>3,46</b>	EUR	202.000	Laboratoire Eimer SE 5.00% 01/02/2029	209.074	0,09	
				EUR				270.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	275.604	0,12
				EUR				534.000	Picard Groupe SAS 3.88% 01/07/2026	543.476	0,24
				EUR				1.700.000	Sanef SA 1.88% 16/03/2026	1.820.925	0,81

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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>ITALIA</b>				<b>LUXEMBURGO (continuación)</b>					
EUR	427.000	Aeroporti di Roma SpA 1.63% 08/06/2027	447.731	0,20	EUR	128.000	Altice France Holding SA 4.00% 15/02/2028	120.919	0,05
EUR	393.000	Atlantia SpA 1.88% 12/02/2028	409.829	0,18	EUR	1.220.000	Altice France Holding SA 8.00% 15/05/2027	1.301.593	0,58
EUR	201.000	Autostrade per l'Italia 2.00% 04/12/2028	211.549	0,09	GBP	300.000	Aroundtown SA 3.00% 16/10/2029	371.023	0,17
EUR	880.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.88% 26/09/2029	920.341	0,41	GBP	563.000	B&M European Value Retail SA 3.63% 15/07/2025	675.333	0,29
EUR	744.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1.88% 09/01/2026	748.872	0,33	EUR	891.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 04/06/2026	930.194	0,41
EUR	192.000	Eni SpA Perp FRN	195.013	0,09	EUR	555.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 12/02/2036	549.028	0,25
EUR	371.000	Eni SpA Perp FRN	396.342	0,18	EUR	874.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.34% 13/08/2041	842.335	0,38
EUR	586.000	IMA Industria Macchine Automatiche SpA 3.75% 15/01/2028	591.641	0,26	EUR	662.000	Canpack SA 2.38% 01/11/2027	676.835	0,30
EUR	303.000	Infrastrutture Wireless Italiane SpA 1.63% 21/10/2028	308.651	0,14	EUR	579.000	Cirsa Finance International Sarl 4.50% 15/03/2027	574.324	0,26
EUR	179.000	Infrastrutture Wireless Italiane SpA 1.88% 08/07/2026	186.439	0,08	EUR	577.436	Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	587.344	0,26
EUR	287.000	International Design Group SPA 6.50% 15/11/2025	297.725	0,13	EUR	338.000	Garfunkelux Holdingco 3 SA 6.75% 01/11/2025	353.793	0,16
EUR	304.000	Nexi SpA 1.63% 30/04/2026	305.509	0,14	GBP	496.000	Garfunkelux Holdingco 3 SA 7.75% 01/11/2025	604.507	0,27
EUR	304.000	Nexi SpA 2.13% 30/04/2029	303.863	0,14	EUR	167.000	Groupe Ecore Holding SAS FRN 15/11/2023	169.977	0,08
EUR	633.000	Telecom Italia SpA 1.63% 18/01/2029	621.272	0,28	EUR	300.000	Hanesbrands Inc. 3.50% 15/06/2024	320.486	0,14
	<b>Total de Italia</b>	<b>5.944.777</b>	<b>2,65</b>		EUR	1.030.000	InPost SA 2.25% 15/07/2027	1.042.275	0,47
					EUR	543.000	Kleopatra Finco Sarl 4.25% 01/03/2026	533.090	0,24
<b>JERSEY - ISLAS DEL CANAL</b>					EUR	180.000	Lincoln Financing SARL 3.63% 01/04/2024	181.805	0,08
EUR	155.000	Avis Budget Finance plc 4.75% 30/01/2026	158.529	0,07	EUR	200.000	Matterhorn Telecom SA 3.13% 15/09/2026	200.379	0,09
USD	1.752.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.16% 31/03/2034	1.489.038	0,67	EUR	1.216.000	Medtronic Global Holdings SCA 1.38% 15/10/2040	1.235.454	0,56
USD	776.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.63% 31/03/2036	659.397	0,29	USD	792.000	Millicom International Cellular SA 6.25% 25/03/2029	749.927	0,34
EUR	631.000	Heathrow Funding Limited 1.13% 08/10/2030	628.039	0,28	EUR	802.000	Nestle Finance International Limited 0.63% 14/02/2034	799.285	0,36
	<b>Total de Jersey - Islas del Canal</b>	<b>2.935.003</b>	<b>1,31</b>		EUR	1.128.000	Novartis Finance SA 0.00% 23/09/2028	1.112.583	0,50
<b>LUXEMBURGO</b>					EUR	185.000	Picard Bondco SA 5.38% 01/07/2027	186.954	0,08
EUR	200.000	Adler Group SA 2.25% 14/01/2029	163.786	0,07	EUR	667.000	Sani/Ikos Financial Holdings 1 Sarl 5.63% 15/12/2026	682.739	0,31
EUR	300.000	Adler Group SA 2.75% 13/11/2026	258.981	0,12		<b>Total de Luxemburgo</b>	<b>16.515.725</b>	<b>7,39</b>	
EUR	600.000	Adler Group SA 3.25% 05/08/2025	531.925	0,24					
EUR	568.000	Altice Financing SA 3.00% 15/01/2028	537.578	0,23					
EUR	225.000	Altice Financing SA 4.25% 15/08/2029	221.273	0,10					

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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>MÉXICO</b>				<b>PANAMÁ</b>					
EUR	836.000	Petroleos Mexicanos 3.75% 16/04/2026	842.463	0,38	EUR	265.000	Carnival Corp. 7.63% 01/03/2026	287.159	0,13
EUR	214.000	Petroleos Mexicanos 4.75% 26/02/2029	212.611	0,10	<b>Total de Panamá</b>		<b>287.159</b>	<b>0,13</b>	
<b>Total de México</b>				<b>1.055.074</b>	<b>0,48</b>	<b>SINGAPUR</b>			
<b>PAÍSES BAJOS</b>				<b>ESPAÑA</b>					
EUR	484.000	Akelius Residential Property Financing BV 1.13% 11/01/2029	493.378	0,22	EUR	400.000	Cellnex Finance Company 2.00% 15/02/2033	391.441	0,18
EUR	611.000	Ashland Services BV 2.00% 30/01/2028	632.680	0,27	EUR	400.000	Cellnex Finance Company SA 1.25% 15/01/2029	390.448	0,17
EUR	217.000	Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	221.207	0,10	EUR	838.000	Grifols Escrow Issuer SA 3.88% 15/10/2028	848.883	0,38
EUR	367.000	Diebold Nixdorf Dutch Holding BV 9.00% 15/07/2025	399.627	0,18	EUR	298.000	Nortegas Energia Distribucion SAU 2.07% 28/09/2027	321.988	0,14
GBP	2.085.000	E.ON International Finance BV 6.25% 03/06/2030	3.231.547	1,44	<b>Total de España</b>		<b>1.952.760</b>	<b>0,87</b>	
EUR	414.000	Goodyear Europe BV 2.75% 15/08/2028	418.125	0,19	<b>SUECIA</b>				
EUR	700.000	Iberdrola International BV Perp FRN	703.842	0,31	EUR	356.000	Heimstaden Bostad AB Perp FRN	352.605	0,16
EUR	700.000	ING Groep NV 0.38% 29/09/2028	693.176	0,31	EUR	140.000	Heimstaden Bostad AB Perp FRN	143.863	0,06
USD	667.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	573.556	0,26	EUR	660.000	Heimstaden Bostad AB Perp FRN	678.173	0,30
EUR	1.005.000	Nobel Bidco BV 3.13% 15/06/2028	1.000.944	0,45	EUR	1.517.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	1.559.160	0,69
EUR	456.000	Oci NV 3.63% 15/10/2025	474.109	0,21	EUR	674.000	Verisure Holding AB 3.25% 15/02/2027	678.773	0,30
EUR	625.000	PPF Telecom Group BV 3.50% 20/05/2024	667.404	0,30	EUR	755.000	Verisure Midholding AB 5.25% 15/02/2029	776.390	0,35
EUR	171.000	Repsol International Finance BV FRN 25/03/2075	186.519	0,08	<b>Total de Suecia</b>		<b>4.188.964</b>	<b>1,86</b>	
EUR	1.258.000	Stedin Holding NV Perp FRN	1.281.770	0,57	<b>SUIZA</b>				
EUR	610.000	Stichting AK Rabobank Certificaten Perp 2.19%	878.238	0,39	EUR	857.000	Credit Suisse AG 0.25% 01/09/2028	837.813	0,37
EUR	451.797	Summer Bidco BV 9.00% 15/11/2025	462.978	0,21	EUR	1.515.000	Credit Suisse Group AG 0.63% 18/01/2033	1.428.801	0,64
EUR	300.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	292.686	0,13	EUR	851.000	UBS AG 0.50% 31/03/2031	843.715	0,38
EUR	1.700.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	1.847.502	0,82	USD	481.000	UBS Group AG Perp FRN	451.502	0,20
EUR	600.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	666.529	0,30	EUR	448.000	UBS Group AG Perp FRN	455.967	0,20
EUR	1.040.000	Tennet Holding BV Perp FRN	1.091.798	0,49	USD	275.000	UBS Group AG Perp FRN	270.753	0,12
EUR	802.000	Tennet Holding BV Perp FRN	846.929	0,38	<b>Total de Suiza</b>		<b>4.288.551</b>	<b>1,91</b>	
EUR	595.000	United Group BV 3.13% 15/02/2026	576.751	0,26	<b>PAÍSES BAJOS</b>				
EUR	211.000	United Group BV 4.88% 01/07/2024	213.966	0,10	EUR	900.000	Volkswagen International Finance NV 4.13% 16/11/2038	1.244.979	0,55
EUR	900.000	Volkswagen International Finance NV 4.13% 16/11/2038	1.244.979	0,55	<b>Total de Países Bajos</b>		<b>19.100.240</b>	<b>8,52</b>	

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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>REINO UNIDO</b>				<b>REINO UNIDO (continuación)</b>					
GBP	160.000	Arqiva Broadcast Finance plc 6.75% 30/09/2023	190.013	0,08	GBP	560.000	Lloyds TSB Bank plc 7.63% 22/04/2025	795.140	0,36
GBP	100.000	Arrow Global Finance 5.13% 15/09/2024	116.638	0,05	EUR	1.600.000	Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	1.587.489	0,71
EUR	475.000	Barclays plc FRN 12/05/2032	478.493	0,21	EUR	912.000	Natwest Group plc FRN 26/02/2030	911.968	0,41
GBP	710.000	Boparan Finance plc 7.63% 30/11/2025	731.355	0,33	EUR	602.000	NatWest Group plc 1.04% 14/09/2032	600.298	0,27
EUR	1.113.000	BP Capital Markets plc Perp FRN	1.190.389	0,53	GBP	239.000	Natwest Group plc Perp FRN	298.984	0,13
EUR	1.156.000	British American Tobacco plc Perp 3.00%	1.147.422	0,51	EUR	2.337.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	2.383.506	1,07
GBP	737.000	BUPA Finance plc 5.00% 08/12/2026	995.633	0,45	EUR	501.000	Nomad Foods Bondco plc 2.50% 24/06/2028	509.823	0,23
EUR	1.375.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	1.375.205	0,61	EUR	175.000	Pinnacle Bidco plc 5.50% 15/02/2025	180.423	0,08
GBP	359.000	Constellation Automotive Financing plc 4.88% 15/07/2027	415.323	0,19	GBP	397.000	Pinnacle Bidco plc 6.38% 15/02/2025	472.120	0,21
GBP	790.000	Deuce Finco plc 5.50% 15/06/2027	932.280	0,42	GBP	747.000	Punch Finance plc 6.13% 30/06/2026	891.204	0,40
GBP	956.000	Ds Smith plc 2.88% 26/07/2029	1.161.087	0,51	GBP	165.000	Santander UK plc Perp 10.06%	342.418	0,15
EUR	497.000	EC Finance plc 2.38% 15/11/2022	499.750	0,22	EUR	855.000	SSE plc Perp FRN	911.243	0,41
EUR	632.000	EC Finance plc 3.00% 15/10/2026	637.074	0,28	GBP	390.000	Telereal Securitisation plc FRN 10/12/2033	458.557	0,21
USD	450.938	Enquest plc 7.00% 15/04/2022	375.717	0,17	GBP	1.113.736	Tesco Property Finance 3 plc 5.74% 13/04/2040	1.700.474	0,76
GBP	426.000	GKN Holdings plc 5.38% 19/09/2022	514.968	0,23	GBP	389.666	Tesco Property Finance 5 plc 5.66% 13/10/2041	594.373	0,27
EUR	1.074.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	1.222.025	0,55	GBP	620.000	Thames Water Kemble Finance plc 4.63% 19/05/2026	754.541	0,34
GBP	482.000	HSBC Bank plc 5.38% 22/08/2033	730.738	0,33	GBP	659.000	Travis Perkins plc 3.75% 17/02/2026	816.367	0,36
USD	570.000	Imperial Brands Finance plc 3.50% 26/07/2026	526.742	0,24	EUR	489.000	Victoria plc 3.63% 26/08/2026	501.350	0,22
EUR	602.000	Ineos Finance plc 3.38% 31/03/2026	616.284	0,28	GBP	221.000	Virgin Media Secured Finance plc 4.25% 15/01/2030	260.555	0,12
EUR	503.000	Ineos Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	508.808	0,23	GBP	300.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.00% 15/04/2027	362.429	0,16
EUR	130.000	Ineos Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	131.501	0,06	GBP	100.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.25% 15/05/2029	123.331	0,06
GBP	514.000	Inspired Entertainment Financing plc 7.88% 01/06/2026	615.945	0,27	GBP	1.020.000	Virgin Money UK plc FRN 24/04/2026	1.256.820	0,56
EUR	450.000	International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	462.491	0,21	EUR	643.000	Vmed O2 UK Financing I plc 3.25% 31/01/2031	661.612	0,30
GBP	315.000	Iron Mountain UK plc 3.88% 15/11/2025	371.289	0,17	GBP	272.000	Vmed O2 UK Financing I plc 4.00% 31/01/2029	319.916	0,14
EUR	286.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 4.50% 15/07/2028	282.578	0,13	EUR	450.000	Vodafone Group plc FRN 03/01/2079	468.151	0,21
EUR	500.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 6.88% 15/11/2026	558.194	0,25	EUR	432.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	489.745	0,22
GBP	445.000	Legal & General Group plc FRN 14/11/2048	602.654	0,27					

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
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>			
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>			
<b>REINO UNIDO (continuación)</b>				<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>			
USD	650.000 Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	617.456	0,28	EUR	804.000 General Motors Financial Company Inc. 0.60% 20/05/2027	802.554	0,36
GBP	405.000 Western Power Distribution plc 3.50% 16/10/2026	515.417	0,23	EUR	761.000 Goldman Sachs Group Inc. 1.00% 18/03/2033	762.221	0,34
	<b>Total del Reino Unido</b>	<b>37.176.306</b>	<b>16,65</b>	USD	176.000 Goodman USA Finance Three LLC 3.70% 15/03/2028	164.645	0,07
<b>ESTADOS UNIDOS</b>				USD	323.000 Intel Corp. 3.05% 12/08/2051	277.074	0,12
USD	424.000 AbbVie Inc. 4.25% 21/11/2049	432.305	0,19	EUR	700.000 Iqvia Inc. 2.25% 15/01/2028	705.975	0,32
USD	300.000 AbbVie Inc. 4.88% 14/11/2048	332.090	0,15	EUR	395.000 Iqvia Inc. 2.25% 15/03/2029	397.599	0,18
USD	900.000 Amazon.com Inc. 3.10% 12/05/2051	817.848	0,37	EUR	679.000 Iqvia Inc. 2.88% 15/06/2028	699.247	0,31
EUR	704.000 American Tower Corp. 0.95% 05/10/2030	701.376	0,31	USD	1.627.000 JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2032	1.423.590	0,64
EUR	441.000 Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 2.00% 01/09/2028	445.498	0,20	USD	844.000 JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2041	752.941	0,34
EUR	731.000 Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 3.00% 01/09/2029	734.001	0,33	EUR	351.000 Kraft Heinz Foods Company 2.25% 25/05/2028	382.298	0,17
EUR	203.000 AT&T Inc. 3.15% 04/09/2036	246.537	0,11	GBP	1.460.000 Kraft Heinz Foods Company 4.13% 01/07/2027	1.894.998	0,85
USD	500.000 AT&T Inc. 3.50% 01/06/2041	443.240	0,20	USD	300.000 Kraft Heinz Foods Company 4.38% 01/06/2046	295.418	0,13
EUR	2.213.000 Bank of America Corp. FRN 22/03/2031	2.207.854	0,99	GBP	118.000 MPT Operating Partnership LP 2.55% 05/12/2023	141.047	0,06
EUR	521.000 Bank of America Corp. FRN 24/05/2032	533.980	0,24	EUR	228.000 Netflix Inc. 3.00% 15/06/2025	248.064	0,11
EUR	300.000 Bank of America Corp. FRN 31/03/2029	360.385	0,16	EUR	987.000 Netflix Inc. 3.63% 15/05/2027	1.142.445	0,50
USD	243.000 Boeing Company 5.93% 01/05/2060	286.900	0,13	EUR	700.000 Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	840.559	0,38
EUR	706.000 Catalent Pharma Solutions Inc. 2.38% 01/03/2028	716.118	0,32	EUR	646.000 Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	783.172	0,35
EUR	480.000 Eli Lilly & Company 1.38% 14/09/2061	451.245	0,20	EUR	606.000 Olympus Water USA 3.88% 01/10/2028	607.495	0,28
EUR	367.000 Fidelity National Information Services Inc. 1.00% 03/12/2028	378.226	0,17	EUR	302.000 Olympus Water USA 5.38% 01/10/2029	299.043	0,13
EUR	228.000 Fidelity National Information Services Inc. 1.50% 21/05/2027	241.917	0,11	USD	628.000 Oracle Corp. 3.65% 25/03/2041	562.125	0,25
EUR	320.000 Fidelity National Information Services Inc. 1.50% 21/05/2027	339.533	0,15	EUR	454.000 Scientific Games International Inc. 5.50% 15/02/2026	469.387	0,21
EUR	175.000 Fidelity National Information Services Inc. 2.95% 21/05/2039	212.608	0,10	EUR	214.000 Silgan Holdings Inc. 2.25% 01/06/2028	215.831	0,10
EUR	196.000 Fiserv Inc. 1.63% 01/07/2030	210.433	0,09	EUR	530.000 Southern Company 1.88% 15/09/2081	527.741	0,24
GBP	319.000 Ford Motor Credit Company LLC 2.75% 14/06/2024	375.648	0,17	EUR	414.000 Spectrum Brands Inc. 4.00% 01/10/2026	423.737	0,19
EUR	462.000 Ford Motor Credit Company LLC 3.25% 15/09/2025	493.157	0,22	EUR	218.000 Thermo Fisher Scientific Inc. 1.88% 01/10/2049	230.491	0,10
EUR	459.000 General Electric Company 2.13% 17/05/2037	501.524	0,22	GBP	350.000 Time Warner Cable Inc. 5.75% 02/06/2031	516.901	0,23
				EUR	985.000 Verizon Communications Inc. 0.75% 22/03/2032	975.353	0,44
					<b>Total de Estados Unidos</b>	<b>28.004.374</b>	<b>12,53</b>

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			
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>						
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)</b>						
<b>ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)</b>				<b>COSTA DE MARFIL (continuación)</b>						
USD	893.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 6.13% 15/05/2029	903.959	0,40	EUR	290.000	Ivory Coast (Govt of) 5.88% 17/10/2031	303.958	0,14	
<b>Total de Islas Vírgenes (Británicas)</b>			<b>903.959</b>	<b>0,40</b>	<b>Total de Costa de Marfil</b>			<b>563.921</b>	<b>0,26</b>	
<b>Total de bonos</b>				<b>181.992.963</b>	<b>81,39</b>	<b>SENEGAL</b>				
<b>Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda</b>				<b>REINO UNIDO</b>						
<b>REPÚBLICA DOMINICANA</b>				<b>ESPAÑA</b>						
USD	333.000	Dominican Republic (Govt of) 5.88% 30/01/2060	282.456	0,13	EUR	1.230.000	Spain (Govt of) 1.45% 30/04/2029	1.354.611	0,61	
USD	900.000	Dominican Republic (Govt of) 5.95% 25/01/2027	874.417	0,39	<b>Total de España</b>			<b>1.354.611</b>	<b>0,61</b>	
<b>Total de República Dominicana</b>			<b>1.156.873</b>	<b>0,52</b>	<b>REINO UNIDO</b>					
<b>EGIPTO</b>				<b>ESTADOS UNIDOS</b>						
EUR	450.000	Egypt (Govt of) 5.63% 16/04/2030	430.993	0,19	GBP	578.000	United Kingdom Gilt 0.50% 22/10/2061	508.426	0,23	
<b>Total de Egipto</b>			<b>430.993</b>	<b>0,19</b>	GBP	1.395.000	United Kingdom Gilt 1.25% 22/10/2041	1.587.271	0,71	
<b>FRANCIA</b>				<b>Total del Reino Unido</b>				<b>2.095.697</b>	<b>0,94</b>	
EUR	700.000	Agence Francaise de Developpement EPIC 0.50% 31/10/2025	724.149	0,32	<b>ESTADOS UNIDOS</b>					
<b>Total de Francia</b>			<b>724.149</b>	<b>0,32</b>	USD	10.000.000	United States Treasury N/B 0.25% 31/10/2025	8.433.011	3,76	
<b>ALEMANIA</b>				<b>Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda</b>				<b>20.923.429</b>	<b>9,35</b>	
EUR	2.600.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.00% 15/08/2030	2.666.802	1,18	<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>202.916.392</b>	<b>90,74</b>
EUR	2.000.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.00% 15/09/2028	2.027.493	0,91	<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente</b>					
<b>Total de Alemania</b>			<b>4.694.295</b>	<b>2,09</b>	<b>Bonos</b>					
<b>ITALIA</b>				<b>AUSTRALIA</b>						
EUR	926.000	Italy (Govt of) BPT 2.45% 01/09/2050	1.063.076	0,48	USD	1.270.000	Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	1.230.218	0,54	
<b>Total de Italia</b>			<b>1.063.076</b>	<b>0,48</b>	<b>Total de Australia</b>			<b>1.230.218</b>	<b>0,54</b>	
<b>COSTA DE MARFIL</b>				<b>Total de Costa de Marfil</b>				<b>563.921</b>	<b>0,26</b>	
EUR	250.000	Ivory Coast (Govt of) 5.25% 22/03/2030	259.963	0,12						

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			
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)</b>				<b>Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario</b>						
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos</b>						
<b>BERMUDAS</b>				<b>DINAMARCA</b>						
USD	833.000	Bacardi Limited 4.45% 15/05/2025	792.402	0,35	USD	1.819.000	Danske Bank AS 1.55% 10/09/2027	1.559.684	0,70	
<b>Total de Bermudas</b>			<b>792.402</b>	<b>0,35</b>	<b>Total de Dinamarca</b>			<b>1.559.684</b>	<b>0,70</b>	
<b>FRANCIA</b>				<b>PORTUGAL</b>						
USD	850.000	BPCE SA 2.70% 01/10/2029	761.396	0,34	EUR	100.000	Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2022	11.000	0,00	
<b>Total de Francia</b>			<b>761.396</b>	<b>0,34</b>	<b>Total de Portugal</b>			<b>11.000</b>	<b>0,00</b>	
<b>ITALIA</b>				<b>Total de bonos</b>						
USD	400.000	Intesa Sanpaolo SpA 4.00% 23/09/2029	377.787	0,17	<b>Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario</b>					
<b>Total de Italia</b>			<b>377.787</b>	<b>0,17</b>	<b>1.570.684</b>				<b>0,70</b>	
<b>PAÍSES BAJOS</b>				<b>Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>						
USD	467.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	435.204	0,19	<b>Fondos</b>					
<b>Total de Países Bajos</b>			<b>435.204</b>	<b>0,19</b>	<b>IRLANDA</b>					
<b>REINO UNIDO</b>				17.902 BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier				1.764.533	0,79	
GBP	768.000	Bellis Acquisition Company 3.25% 16/02/2026	880.443	0,39	<b>Total de Irlanda</b>			<b>1.764.533</b>	<b>0,79</b>	
GBP	812.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	959.033	0,42	<b>Total de fondos</b>				<b>1.764.533</b>	<b>0,79</b>
<b>Total del Reino Unido</b>			<b>1.839.476</b>	<b>0,81</b>	<b>Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>				<b>1.764.533</b>	<b>0,79</b>
<b>ESTADOS UNIDOS</b>				<b>Valor total de las inversiones</b>				<b>213.424.713</b>	<b>95,41</b>	
USD	925.000	Carrier Global Corp. 2.72% 15/02/2030	825.646	0,37	<b>(Coste total: 209.642.731 EUR)</b>					
USD	1.030.000	Jersey Central Power & Light Company 2.75% 01/03/2032	910.975	0,41						
<b>Total de Estados Unidos</b>			<b>1.736.621</b>	<b>0,78</b>						
<b>Total de bonos</b>			<b>7.173.104</b>	<b>3,18</b>						
<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente</b>			<b>7.173.104</b>	<b>3,18</b>						

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 2021

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Bonos</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>BERMUDAS</b>				<b>ISLAS CAIMÁN (continuación)</b>					
USD	200.000	China Oil & Gas Group Limited 5.50% 25/01/2023	204.955	0,41	USD	400.000	Melco Resorts Finance Limited 5.75% 21/07/2028	409.932	0,81
USD	400.000	Geopark Limited 5.50% 17/01/2027	395.967	0,78	USD	200.000	Qnb Finance Limited 2.75% 12/02/2027	209.896	0,42
USD	200.000	Ooredoo International Finance Limited 2.63% 08/04/2031	204.125	0,40	USD	200.000	QNB Finance Limited 2.75% 12/02/2027	209.896	0,42
<b>Total de Bermudas</b>			<b>805.047</b>	<b>1,59</b>	USD	300.000	SA Global Sukuk Limited 2.69% 17/06/2031	303.225	0,60
<b>BRASIL</b>				USD 400.000 Saudi Electricity Company 2.41% 17/09/2030				407.986	0,81
USD	500.000	Light Servicos de Eletricidade SA 4.38% 18/06/2026	500.434	0,99	USD	200.000	Tencent Holdings Limited 2.88% 22/04/2031	204.485	0,41
<b>Total de Brasil</b>			<b>500.434</b>	<b>0,99</b>	USD	200.000	Tencent Holdings Limited 3.60% 19/01/2028	214.310	0,42
<b>CANADÁ</b>				USD 367.000 Tingyi Cayman Islands Holding Corp. 1.63% 24/09/2025				365.296	0,72
USD	716.000	MEGlobal Canada ULCDL 5.00% 18/05/2025	793.076	1,57	USD	200.000	Vale Overseas Limited 3.75% 08/07/2030	207.327	0,41
<b>Total de Canadá</b>			<b>793.076</b>	<b>1,57</b>	<b>Total de Islas Caimán</b>			<b>6.738.833</b>	<b>13,35</b>
<b>ISLAS CAIMÁN</b>				<b>CHINA</b>					
USD	200.000	AAC Technologies Holdings Inc. 3.00% 27/11/2024	205.565	0,41	USD	200.000	Bank of China Limited 5.00% 13/11/2024	221.397	0,44
USD	200.000	Alibaba Group Holding Limited 3.60% 28/11/2024	214.329	0,42	<b>Total de China</b>			<b>221.397</b>	<b>0,44</b>
USD	400.000	CIFI Holdings Group Company Limited 6.00% 16/07/2025	400.160	0,79	<b>COLOMBIA</b>				
USD	200.000	CK Hutchison International 17 II Limited 3.25% 29/09/2027	216.697	0,43	USD	650.000	Ecopetrol SA 6.88% 29/04/2030	762.044	1,52
USD	200.000	Country Garden Holdings Company Limited 2.70% 12/07/2026	185.875	0,37	<b>Total de Colombia</b>			<b>762.044</b>	<b>1,52</b>
USD	400.000	Country Garden Holdings Company Limited 7.25% 08/04/2026	422.815	0,84	<b>HONG KONG</b>				
USD	600.000	Energuate Trust 5.88% 03/05/2027	625.230	1,24	USD	250.000	Bank of East Asia Limited FRN 03/11/2026	250.436	0,50
USD	212.000	ENN Energy Holdings Limited 2.63% 17/09/2030	210.301	0,41	USD	800.000	Lenovo Group Limited 5.88% 24/04/2025	902.211	1,79
USD	400.000	Goodman HK Finance 3.00% 22/07/2030	407.359	0,81	USD	530.000	Xiaomi Best Time International Limited 2.88% 14/07/2031	525.219	1,04
USD	500.000	JD.Com Inc. 3.38% 14/01/2030	525.007	1,04	<b>Total de Hong Kong</b>			<b>1.677.866</b>	<b>3,33</b>
USD	200.000	Longfor Group Holdings Limited 3.95% 16/09/2029	207.450	0,41	<b>INDIA</b>				
USD	200.000	Longfor Properties Company 4.50% 16/01/2028	214.892	0,43	USD	200.000	Adani Electricity Mumbai Limited 3.95% 12/02/2030	200.359	0,40
USD	400.000	Meituan 3.05% 28/10/2030	370.800	0,73	USD	220.000	Adani Green Energy Limited 4.38% 08/09/2024	220.595	0,44

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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>MARRUECOS</b>				<b>CATAR</b>					
USD	557.000	OCP SA 6.88% 25/04/2044	676.797	1,34	USD	410.000	Qatar Petroleum 2.25% 12/07/2031	406.109	0,80
<b>Total de Marruecos</b>			<b>676.797</b>	<b>1,34</b>	<b>Total de Catar</b>			<b>406.109</b>	<b>0,80</b>
<b>PAÍSES BAJOS</b>				<b>REPÚBLICA DE COREA (SUR)</b>					
USD	200.000	Braskem Netherlands Finance BV 4.50% 31/01/2030	212.463	0,42	USD	200.000	Kookmin Bank 4.50% 01/02/2029	226.122	0,45
USD	374.300	Greenko Dutch BV 3.85% 29/03/2026	381.081	0,75	USD	380.000	SK Hynix Inc. 1.50% 19/01/2026	375.361	0,74
USD	400.000	Lukoil Securities BV 3.88% 06/05/2030	421.000	0,83	<b>Total de República de Corea (Sur)</b>			<b>601.483</b>	<b>1,19</b>
USD	500.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	498.293	0,99	<b>ARABIA SAUDÍ</b>				
USD	400.000	Petrobras Global Finance BV 6.75% 03/06/2050	434.840	0,86	USD	400.000	Saudi Arabian Oil Company 2.25% 24/11/2030	392.050	0,78
USD	500.000	Syngenta Finance NV 5.18% 24/04/2028	563.611	1,12	USD	400.000	Saudi Arabian Oil Company 3.25% 24/11/2050	383.350	0,76
USD	392.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 3.15% 01/10/2026	375.585	0,74	USD	400.000	Saudi Arabian Oil Company 3.50% 16/04/2029	430.848	0,85
<b>Total de Países Bajos</b>			<b>2.886.873</b>	<b>5,71</b>	USD	200.000	Saudi Arabian Oil Company 3.50% 16/04/2029	215.424	0,43
<b>PERÚ</b>				<b>SINGAPUR</b>					
USD	500.000	Auna SA 6.50% 20/11/2025	525.000	1,04	USD	200.000	BOC Aviation Limited 2.63% 17/09/2030	197.965	0,39
USD	450.000	Hunt Oil Company of Peru LLC Sucursal del Peru 6.38% 01/06/2028	451.763	0,89	USD	600.000	DBS Group Holdings Limited FRN 11/12/2028	643.432	1,27
USD	200.000	Volcan Compania Minera SAA 4.38% 11/02/2026	195.451	0,39	USD	450.000	Geo Coal International Pte Limited 8.00% 04/10/2022	461.640	0,91
USD	323.000	Volcan Compania Minera SAA 5.38% 02/02/2022	324.332	0,64	USD	200.000	SingTel Group Treasury Pte Limited 2.38% 28/08/2029	205.449	0,41
<b>Total de Perú</b>			<b>1.496.546</b>	<b>2,96</b>	USD	450.000	United Overseas Bank Limited FRN 16/03/2031	446.892	0,89
<b>FILIPINAS</b>				<b>SUDÁFRICA</b>					
USD	250.000	Globe Telecom Inc. 2.50% 23/07/2030	240.255	0,48	USD	200.000	Eskom Holdings 6.75% 06/08/2023	206.548	0,41
USD	200.000	International Container Terminal SE 4.75% 17/06/2030	224.081	0,44	USD	250.000	Eskom Holdings SOC Limited 7.13% 11/02/2025	260.778	0,52
USD	357.000	Metropolitan Bank & Trust Company 2.13% 15/01/2026	364.665	0,72	USD	244.000	Transnet SOC Limited 4.00% 26/07/2022	247.252	0,49
USD	200.000	Pldt Inc. 2.50% 23/01/2031	199.750	0,40	<b>Total de Sudáfrica</b>			<b>714.578</b>	<b>1,42</b>
USD	430.000	Smc Global Power Holdings Corp. Perp FRN	429.868	0,85	<b>TAILANDIA</b>				
<b>Total de Filipinas</b>			<b>1.458.619</b>	<b>2,89</b>	USD	700.000	Bangkok Bank plc FRN 25/09/2034	712.576	1,41

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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>TAILANDIA (continuación)</b>				<b>ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS) (continuación)</b>					
USD	200.000	GC Treasury Centre Company Limited 2.98% 18/03/2031	203.127	0,40	USD	600.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 6.13% 15/05/2029	703.905	1,39
USD	200.000	Kasikornbank plc FRN 02/10/2031	201.817	0,40	USD	511.000	HKT Capital No 5 Limited 3.25% 30/09/2029	541.863	1,06
USD	200.000	PTTEP Treasury Center Company Limited 2.59% 10/06/2027	207.458	0,41	USD	728.000	Jgsh Philippines Limited 4.13% 09/07/2030	779.210	1,54
		<b>Total de Tailandia</b>	<b>1.324.978</b>	<b>2,62</b>	USD	400.000	Studio City Finance Limited 5.00% 15/01/2029	371.748	0,74
					USD	200.000	Studio City Finance Limited 6.00% 15/07/2025	198.714	0,39
<b>TURQUÍA</b>					USD	467.000	TSMC Global Limited 0.75% 28/09/2025	456.498	0,91
USD	200.000	Akbank TAS 6.80% 06/02/2026	208.704	0,41			<b>Total de Islas Vírgenes (Británicas)</b>	<b>4.343.270</b>	<b>8,59</b>
USD	380.000	KOC Holding AS 6.50% 11/03/2025	406.864	0,80	<b>Total de bonos</b>		<b>44.454.456</b>	<b>88,05</b>	
USD	200.000	Turkiye Garanti Bankasi AS 5.88% 16/03/2023	207.821	0,41	<b>Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda</b>				
		<b>Total de Turquía</b>	<b>823.389</b>	<b>1,62</b>	<b>REPÚBLICA DOMINICANA</b>				
<b>EMIRATOS ÁRABES UNIDOS</b>					USD	380.000	Dominican (Govt) 6.85% 27/01/2045	423.763	0,84
USD	500.000	Abu Dhabi National Energy Company PJSC 2.00% 29/04/2028	504.062	0,99			<b>Total de República Dominicana</b>	<b>423.763</b>	<b>0,84</b>
USD	700.000	DP World Limited 6.85% 02/07/2037	937.498	1,86	<b>SUDÁFRICA</b>				
		<b>Total de Emiratos Árabes Unidos</b>	<b>1.441.560</b>	<b>2,85</b>	USD	400.000	South Africa (Govt of) 4.85% 30/09/2029	412.042	0,82
<b>REINO UNIDO</b>							<b>Total de Sudáfrica</b>	<b>412.042</b>	<b>0,82</b>
USD	200.000	Gazprom PJSC Via Gaz Finance plc 3.00% 29/06/2027	202.373	0,40	<b>TURQUÍA</b>				
USD	500.000	Gazprom PJSC Via Gaz Finance plc 3.25% 25/02/2030	498.832	1,00	USD	200.000	Turkey (Govt of) 5.13% 17/02/2028	190.120	0,38
USD	250.000	Nak Naftogaz Ukraine Via Kondor Finance plc 7.63% 08/11/2026	248.989	0,49	USD	400.000	Turkey (Govt of) 5.75% 22/03/2024	411.020	0,81
USD	200.000	Tullow Oil plc 7.00% 01/03/2025	173.871	0,34			<b>Total de Turquía</b>	<b>601.140</b>	<b>1,19</b>
		<b>Total del Reino Unido</b>	<b>1.124.065</b>	<b>2,23</b>	<b>Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda</b>				
<b>ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)</b>							<b>1.436.945</b>	<b>2,85</b>	
USD	400.000	Contemporary Ruiding Development Limited 2.63% 17/09/2030	402.092	0,80	<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				
USD	400.000	Elect Global Investments Limited Perp FRN	408.129	0,81			<b>45.891.401</b>	<b>90,90</b>	
USD	450.000	FPC Resources Limited 4.38% 11/09/2027	481.111	0,95					

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
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente</b>			
<b>Bonos</b>			
<b>BERMUDAS</b>			
USD	500.000	Tengizchevroil Finance Company International 2.63% 15/08/2025	511.125 1,02
	<b>Total de Bermudas</b>	<b>511.125</b>	<b>1,02</b>
<b>LUXEMBURGO</b>			
USD	500.000	Altice Financing SA 5.00% 15/01/2028	482.491 0,96
	<b>Total de Luxemburgo</b>	<b>482.491</b>	<b>0,96</b>
	<b>Total de bonos</b>	<b>993.616</b>	<b>1,98</b>
	<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente</b>	<b>993.616</b>	<b>1,98</b>
<b>Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>			
<b>Fondos</b>			
<b>IRLANDA</b>			
	2.638.397	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	2.638.397 5,23
	<b>Total de Irlanda</b>	<b>2.638.397</b>	<b>5,23</b>
	<b>Total de fondos</b>	<b>2.638.397</b>	<b>5,23</b>
	<b>Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>	<b>2.638.397</b>	<b>5,23</b>
	<b>Valor total de las inversiones</b>	<b>49.523.414</b>	<b>98,11</b>
<b>(Coste total: 48.729.704 USD)</b>			



## Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

### Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2021

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Bonos</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>BERMUDAS</b>				<b>ISLA DE MAN</b>					
USD	200.000	Ooredoo International Finance Limited 2.63% 08/04/2031	204.125	0,47	USD	200.000	AngloGold Ashanti Holdings plc 3.75% 01/10/2030	205.000	0,48
<b>Total de Bermudas</b>			<b>204.125</b>	<b>0,47</b>	<b>Total de Isla de Man</b>			<b>205.000</b>	<b>0,48</b>
<b>CANADÁ</b>				<b>JERSEY - ISLAS DEL CANAL</b>					
USD	316.000	MEGlobal Canada ULCDL 5.00% 18/05/2025	350.017	0,81	USD	253.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.63% 31/03/2036	249.155	0,58
<b>Total de Canadá</b>			<b>350.017</b>	<b>0,81</b>	USD	277.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.94% 30/09/2040	276.883	0,65
<b>ISLAS CAIMÁN</b>				<b>Total de Jersey - Islas del Canal</b>					
USD	200.000	Energuate Trust 5.88% 03/05/2027	208.410	0,48				<b>526.038</b>	<b>1,23</b>
USD	200.000	SA Global Sukuk Limited 2.69% 17/06/2031	202.150	0,47	<b>KAZAJISTÁN</b>				
<b>Total de Islas Caimán</b>			<b>410.560</b>	<b>0,95</b>	USD	200.000	Kazmunaygas National Company JSC 5.75% 19/04/2047	240.992	0,56
<b>HONG KONG</b>				USD 200.000 KazMunayGas National Company JSC 4.75% 19/04/2027				222.975	0,52
USD	400.000	Lenovo Group Limited 5.88% 24/04/2025	451.105	1,05	USD	600.000	KazMunayGas National Company JSC 5.38% 24/04/2030	709.715	1,65
<b>Total de Hong Kong</b>			<b>451.105</b>	<b>1,05</b>	<b>Total de Kazajistán</b>			<b>1.173.682</b>	<b>2,73</b>
<b>INDIA</b>				<b>LUXEMBURGO</b>					
USD	200.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.00% 30/07/2027	208.727	0,49	USD	200.000	MHP Lux SA 6.95% 03/04/2026	213.304	0,50
<b>Total de India</b>			<b>208.727</b>	<b>0,49</b>	USD	180.000	Millicom International Cellular SA 6.25% 25/03/2029	197.529	0,46
<b>INDONESIA</b>				<b>Total de Luxemburgo</b>					
USD	450.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 5.45% 15/05/2030	518.766	1,21				<b>410.833</b>	<b>0,96</b>
USD	650.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 6.76% 15/11/2048	838.231	1,94	<b>MALASIA</b>				
USD	200.000	Pelabuhan Indonesia II PT 5.38% 05/05/2045	237.904	0,55	USD	200.000	Petronas Capital Limited 3.50% 21/04/2030	216.813	0,50
USD	300.000	Saka Energi Indonesia PT 4.45% 05/05/2024	288.867	0,67	<b>Total de Malasia</b>			<b>216.813</b>	<b>0,50</b>
<b>Total de Indonesia</b>			<b>1.883.768</b>	<b>4,37</b>	<b>MÉXICO</b>				
<b>IRLANDA</b>				USD 450.000 Comision Federal de Electricidad 3.88% 26/07/2033				443.851	1,04
USD	200.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC 2.60% 16/09/2028	199.500	0,46	USD	380.000	Petroleos Mexicanos 4.50% 23/01/2026	383.267	0,89
<b>Total de Irlanda</b>			<b>199.500</b>	<b>0,46</b>	USD	505.000	Petroleos Mexicanos 5.35% 12/02/2028	498.190	1,16
				USD 500.000 Petroleos Mexicanos 5.95% 28/01/2031				485.090	1,13
				USD 400.000 Petroleos Mexicanos 6.38% 23/01/2045				340.302	0,79
				USD 200.000 Petroleos Mexicanos 6.50% 23/01/2029				205.711	0,48

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					
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>								
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>								
<b>MÉXICO (continuación)</b>				<b>REINO UNIDO</b>								
USD	800.000	Petroleos Mexicanos 6.84% 23/01/2030	824.820	1,92	USD	404.000	Gazprom PJSC Via Gaz Finance plc 3.25% 25/02/2030	403.056	0,94			
USD	200.000	Petroleos Mexicanos 7.69% 23/01/2050	189.880	0,44	<b>Total del Reino Unido</b>			<b>403.056</b>	<b>0,94</b>			
<b>Total de México</b>				<b>3.371.111</b>	<b>7,85</b>	<b>ESTADOS UNIDOS</b>						
<b>PAÍSES BAJOS</b>				<b>ESTADOS UNIDOS</b>								
USD	250.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	249.146	0,58	USD	378.000	Petroleos Mexicanos 6.63% 15/06/2035	358.864	0,83			
USD	400.000	Syngenta Finance NV 5.18% 24/04/2028	450.890	1,06	<b>Total de Estados Unidos</b>			<b>358.864</b>	<b>0,83</b>			
USD	250.000	Syngenta Finance NV 5.68% 24/04/2048	301.704	0,70	<b>ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)</b>							
<b>Total de Países Bajos</b>				<b>1.001.740</b>	<b>2,34</b>	USD	250.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 6.13% 15/05/2029	293.293	0,68		
<b>FILIPINAS</b>				<b>ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)</b>								
USD	250.000	Smc Global Power Holdings Corp. Perp FRN	249.923	0,58	USD	894.000	Jgsh Philippines Limited 4.13% 09/07/2030	956.887	2,22			
<b>Total de Filipinas</b>				<b>249.923</b>	<b>0,58</b>	USD	200.000	Sinopec Group Overseas Development 2017 Limited 3.25% 13/09/2027	216.160	0,50		
<b>CATAR</b>				<b>ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)</b>								
USD	356.000	Qatar Petroleum 2.25% 12/07/2031	352.622	0,82	USD	200.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Limited 4.13% 12/09/2025	220.656	0,51			
<b>Total de Catar</b>				<b>352.622</b>	<b>0,82</b>	USD	200.000	State Grid Overseas Investment 2016 Limited 1.63% 05/08/2030	190.374	0,44		
<b>SINGAPUR</b>				<b>Total de Islas Vírgenes (Británicas)</b>				<b>1.877.370</b>	<b>4,35</b>			
USD	340.000	Geo Coal International Pte Limited 8.00% 04/10/2022	348.795	0,81	<b>Total de bonos</b>				<b>15.570.790</b>	<b>36,19</b>		
<b>Total de Singapur</b>				<b>348.795</b>	<b>0,81</b>	<b>Valores respaldados por hipotecas y activos</b>						
<b>SUDÁFRICA</b>				<b>LUXEMBURGO</b>								
USD	200.000	Eskom Holdings SOC Limited 7.13% 11/02/2025	208.622	0,48	USD	180.000	Millicom International Cellular SA 5.13% 15/01/2028	187.335	0,44			
USD	200.000	Eskom Holdings SOC Limited 8.45% 10/08/2028	221.021	0,51	<b>Total de Luxemburgo</b>			<b>187.335</b>	<b>0,44</b>			
<b>Total de Sudáfrica</b>				<b>429.643</b>	<b>0,99</b>	<b>Total de valores respaldados por hipotecas y activos</b>				<b>187.335</b>	<b>0,44</b>	
<b>EMIRATOS ÁRABES UNIDOS</b>				<b>Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda</b>								
USD	700.000	DP World Limited 6.85% 02/07/2037	937.498	2,18	<b>ANGOLA</b>							
<b>Total de Emiratos Árabes Unidos</b>				<b>937.498</b>	<b>2,18</b>	USD	400.000	Angola (Govt of) 8.00% 26/11/2029	411.413	0,96		
								USD	200.000	Angola (Govt of) 9.38% 08/05/2048	207.272	0,48
								<b>Total de Angola</b>			<b>618.685</b>	<b>1,44</b>

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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)</b>				<b>Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)</b>					
<b>ARGENTINA</b>				<b>REPÚBLICA DOMINICANA</b>					
USD	2.101.468	Argentina (Govt of) FRN 09/07/2035	689.668	1,60	USD	151.000	Dominican (Gov) 6.40% 05/06/2049	160.143	0,37
USD	90.000	Argentina (Govt of) 1.13% 09/07/2046	30.006	0,07	USD	200.000	Dominican (Govt) 4.88% 23/09/2032	204.510	0,48
<b>Total de Argentina</b>		<b>719.674</b>	<b>1,67</b>	USD	150.000	Dominican Republic 4.50% 30/01/2030	153.090	0,36	
<b>BIELORRUSIA</b>				<b>REPÚBLICA DOMINICANA</b>					
USD	200.000	Belarus (Govt of) 6.20% 28/02/2030	176.561	0,41	USD	222.000	Dominican Republic (Govt of) 5.88% 30/01/2060	218.235	0,51
<b>Total de Bielorrusia</b>		<b>176.561</b>	<b>0,41</b>	USD	314.000	Dominican Republic (Govt of) 7.45% 30/04/2044	375.675	0,87	
<b>BRASIL</b>				<b>ECUADOR</b>					
USD	1.050.000	Brazil (Govt of) 3.88% 12/06/2030	1.019.446	2,36	USD	192.950	Ecuador (Govt of) 0.50% 31/07/2040	113.567	0,26
USD	200.000	Brazil (Govt of) 5.00% 27/01/2045	186.953	0,43	USD	485.835	Ecuador (Govt of) 1.00% 31/07/2035	321.550	0,75
<b>Total de Brasil</b>		<b>1.206.399</b>	<b>2,79</b>	USD	230.000	Ecuador (Govt of) 5.00% 31/07/2030	193.488	0,45	
<b>CHILE</b>				<b>ECUADOR</b>					
USD	200.000	Chile (Govt of) 3.50% 25/01/2050	201.313	0,47	<b>Total de Ecuador</b>		<b>628.605</b>	<b>1,46</b>	
<b>Total de Chile</b>		<b>201.313</b>	<b>0,47</b>	<b>EGIPTO</b>					
<b>CHINA</b>				<b>EGIPTO</b>					
USD	200.000	China (Govt of) 1.95% 03/12/2024	208.639	0,48	EUR	180.000	Egypt (Govt of) 5.63% 16/04/2030	199.800	0,46
<b>Total de China</b>		<b>208.639</b>	<b>0,48</b>	EUR	200.000	Egypt (Govt of) 6.38% 11/04/2031	228.164	0,53	
<b>COLOMBIA</b>				<b>EGIPTO</b>					
USD	1.000.000	Colombia (Govt of) 3.00% 30/01/2030	945.249	2,19	USD	450.000	Egypt (Govt of) 7.30% 30/09/2033	438.319	1,02
USD	350.000	Colombia (Govt of) 3.13% 15/04/2031	328.589	0,76	USD	200.000	Egypt (Govt of) 7.50% 16/02/2061	175.840	0,41
USD	223.000	Colombia (Govt of) 3.25% 22/04/2032	208.198	0,48	USD	250.000	Egypt (Govt of) 7.63% 29/05/2032	249.895	0,58
<b>Total de Colombia</b>		<b>1.482.036</b>	<b>3,43</b>	USD	425.000	Egypt (Govt of) 8.50% 31/01/2047	412.242	0,96	
<b>COSTA RICA</b>				<b>EL SALVADOR</b>					
USD	200.000	Costa Rica (Govt of) 7.00% 04/04/2044	198.506	0,46	USD	200.000	El Salvador (Govt of) 6.38% 18/01/2027	149.906	0,35
<b>Total de Costa Rica</b>		<b>198.506</b>	<b>0,46</b>	<b>Total de El Salvador</b>		<b>149.906</b>	<b>0,35</b>		
<b>CROACIA</b>				<b>GHANA</b>					
USD	200.000	Croatia (Govt of) 6.00% 26/01/2024	223.467	0,52	USD	200.000	Ghana (Govt of) 7.88% 11/02/2035	180.370	0,42
<b>Total de Croacia</b>		<b>223.467</b>	<b>0,52</b>	USD	200.000	Ghana (Govt of) 8.13% 26/03/2032	189.815	0,44	
<b>CROACIA</b>				<b>GHANA</b>					
USD	200.000	Croatia (Govt of) 6.00% 26/01/2024	223.467	0,52	USD	364.000	Ghana (Govt of) 8.88% 07/05/2042	339.379	0,79
<b>Total de Croacia</b>		<b>223.467</b>	<b>0,52</b>	<b>Total de Ghana</b>		<b>709.564</b>	<b>1,65</b>		

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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)</b>				<b>Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)</b>					
<b>GUATEMALA</b>				<b>OMÁN</b>					
USD	250.000	Guatemala (Govt of) 6.13% 01/06/2050	288.677	0,67	USD	200.000	Oman (Govt of) 6.25% 25/01/2031	214.475	0,50
<b>Total de Guatemala</b>			<b>288.677</b>	<b>0,67</b>	<b>Total de Omán</b>			<b>214.475</b>	<b>0,50</b>
<b>INDIA</b>				<b>PAKISTÁN</b>					
USD	400.000	Export-Import Bank of India 3.25% 15/01/2030	406.245	0,94	USD	200.000	Pakistan (Govt of) 6.88% 05/12/2027	201.698	0,47
<b>Total de India</b>			<b>406.245</b>	<b>0,94</b>	USD	201.000	Pakistan (Govt of) 7.38% 08/04/2031	201.325	0,47
<b>Total de Pakistán</b>			<b>403.023</b>	<b>0,94</b>	<b>PANAMÁ</b>				
<b>INDONESIA</b>				<b>PARAGUAY</b>					
USD	400.000	Indonesia (Govt of) 3.70% 30/10/2049	407.846	0,95	USD	340.000	Paraguay (Govt of) 5.60% 13/03/2048	394.400	0,92
USD	350.000	Indonesia (Govt of) 4.75% 18/07/2047	412.153	0,96	<b>Total de Paraguay</b>			<b>394.400</b>	<b>0,92</b>
USD	200.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 2.30% 23/06/2025	207.732	0,48	<b>FILIPINAS</b>				
<b>Total de Indonesia</b>			<b>1.027.731</b>	<b>2,39</b>	USD	339.000	Philippine (Govt of) 3.20% 06/07/2046	334.767	0,78
<b>Total de Filipinas</b>			<b>334.767</b>	<b>0,78</b>	<b>CATAR</b>				
<b>COSTA DE MARFIL</b>				<b>RUMANÍA</b>					
EUR	477.000	Ivory Coast (Govt of) 5.88% 17/10/2031	579.427	1,35	USD	300.000	Romania (Govt of) 4.00% 14/02/2051	300.506	0,70
USD	200.000	Ivory Coast (Govt of) 6.13% 15/06/2033	211.960	0,49	<b>Total de Rumanía</b>			<b>300.506</b>	<b>0,70</b>
<b>Total de Costa de Marfil</b>			<b>791.387</b>	<b>1,84</b>	<b>MÉXICO</b>				
<b>MÉXICO</b>				<b>RUMANÍA</b>					
USD	650.000	Mexico (Govt of) Bonos 3.25% 16/04/2030	667.748	1,55	USD	450.000	Qatar (Govt of) 3.75% 16/04/2030	507.767	1,18
USD	300.000	Mexico (Govt of) Bonos 4.60% 10/02/2048	310.292	0,72	USD	500.000	Qatar (Govt of) 4.00% 14/03/2029	570.264	1,33
MXN	85.000	Mexico (Govt of) Bonos 8.50% 31/05/2029	443.089	1,03	USD	400.000	Qatar (Govt of) 4.82% 14/03/2049	515.950	1,20
USD	200.000	United Mexican States (Govt of) 4.35% 15/01/2047	201.043	0,47	USD	200.000	Qatar (Govt of) 5.10% 23/04/2048	266.086	0,62
<b>Total de México</b>			<b>1.622.172</b>	<b>3,77</b>	<b>Total de Catar</b>			<b>1.860.067</b>	<b>4,33</b>
<b>NIGERIA</b>				<b>RUMANÍA</b>					
USD	201.000	Nigeria (Govt of) 7.38% 28/09/2033	203.640	0,47	<b>Total de Rumanía</b>			<b>300.506</b>	<b>0,70</b>
<b>Total de Nigeria</b>			<b>203.640</b>	<b>0,47</b>					

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			
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente</b>						
<b>Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)</b>				<b>Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda</b>						
<b>FEDERACIÓN RUSA</b>				<b>EGIPTO</b>						
USD	200.000	Russia (Govt of) 4.75% 27/05/2026	225.619	0,52	EGP	8.700.000	Egypt (Govt of) 0.00% 23/11/2021	543.856	1,26	
USD	200.000	Russia (Govt of) 5.10% 28/03/2035	239.773	0,56	<b>Total de Egipto</b>					
USD	400.000	Russian Foreign Bond - Eurobond 5.10% 28/03/2035	479.546	1,11	<b>543.856 1,26</b>					
<b>Total de la Federación Rusa</b>				<b>FEDERACIÓN RUSA</b>						
<b>944.938 2,19</b>				RUB 50.000.000 Russia (Govt of) 5.90% 12/03/2031				627.079	1,46	
				<b>Total de la Federación Rusa</b>						
				<b>627.079 1,46</b>						
<b>ARABIA SAUDÍ</b>				<b>Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda</b>						
USD	500.000	Saudi (Govt of) 3.45% 02/02/2061	492.257	1,14	<b>1.170.935 2,72</b>					
USD	700.000	Saudi (Govt of) 3.75% 21/01/2055	733.700	1,70	<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente</b>					
USD	285.000	Saudi (Govt) 4.50% 26/10/2046	329.821	0,77	<b>1.170.935 2,72</b>					
<b>Total de Arabia Saudí</b>				<b>1.555.778 3,61</b>						
<b>SUDÁFRICA</b>				<b>Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario</b>						
USD	200.000	South Africa (Govt of) 4.85% 30/09/2029	206.021	0,48	<b>Bonos</b>					
USD	300.000	South Africa (Govt of) 5.75% 30/09/2049	286.872	0,67	<b>VENEZUELA</b>					
<b>Total de Sudáfrica</b>				USD 1.999.683 Petroleos de Venezuela SA 6.00% 15/11/2026				117.481	0,27	
<b>492.893 1,15</b>				<b>Total de Venezuela</b>						
				<b>117.481 0,27</b>						
<b>TURQUÍA</b>				<b>Total de bonos</b>						
USD	250.000	Turkey (Govt of) 4.25% 14/04/2026	236.363	0,55	<b>Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda</b>					
USD	430.000	Turkey (Govt of) 5.13% 17/02/2028	408.757	0,95	<b>VENEZUELA</b>					
USD	625.000	Turkey (Govt of) 6.00% 25/03/2027	624.073	1,45	USD 2.004.400 Venezuela (Govt of) 8.25% 13/10/2024				215.373	0,50
USD	250.000	Turkey (Govt of) 6.88% 17/03/2036	242.959	0,56	<b>Total de Venezuela</b>					
<b>Total de Turquía</b>				<b>215.373 0,50</b>						
<b>1.512.152 3,51</b>				<b>Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda</b>						
				<b>215.373 0,50</b>						
<b>UCRANIA</b>				<b>Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario</b>						
USD	268.000	Ukraine (Govt of) 6.88% 21/05/2029	271.497	0,63	<b>332.854 0,77</b>					
USD	860.000	Ukraine (Govt of) 7.75% 01/09/2026	932.457	2,17						
<b>Total de Ucrania</b>										
<b>1.203.954 2,80</b>										
<b>Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda</b>				<b>23.280.489 54,09</b>						
<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>39.038.614 90,72</b>						

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
<b>Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>			
<b>Fondos</b>			
<b>IRLANDA</b>			
557.933	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	557.933	1,30
	<b>Total de Irlanda</b>	<b>557.933</b>	<b>1,30</b>
	<b>Total de fondos</b>	<b>557.933</b>	<b>1,30</b>
	<b>Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>	<b>557.933</b>	<b>1,30</b>
	<b>Valor total de las inversiones</b>	<b>41.100.336</b>	<b>95,51</b>
<b>(Coste total: 41.923.460 USD)</b>			

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

### Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2021

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Bonos</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>BERMUDAS</b>				<b>INDIA (continuación)</b>					
USD	1.000.000	China Oil & Gas Group Limited 5.50% 25/01/2023	1.024.776	0,95	USD	600.000	JSW Steel Limited 5.95% 18/04/2024	636.885	0,59
<b>Total de Bermudas</b>			<b>1.024.776</b>	<b>0,95</b>	USD	700.000	ReNew Wind Energy AP2 4.50% 14/07/2028	714.233	0,66
<b>BRASIL</b>				<b>Total de India</b>					
USD	208.000	Cemig Geracao e Transmissao SA 9.25% 05/12/2024	235.950	0,22	<b>2.364.948 2,18</b>				
USD	1.200.000	Light Servicos de Eletricidade SA 4.38% 18/06/2026	1.201.042	1,11	<b>INDONESIA</b>				
<b>Total de Brasil</b>			<b>1.436.992</b>	<b>1,33</b>	USD	3.000.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 4.75% 15/05/2025	3.269.724	3,02
<b>CANADÁ</b>				<b>IRLANDA</b>					
USD	1.650.000	MEGlobal Canada ULCDL 5.00% 18/05/2025	1.827.623	1,68	USD	200.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 5.50% 22/11/2021	201.135	0,19
<b>Total de Canadá</b>			<b>1.827.623</b>	<b>1,68</b>	USD	1.000.000	Saka Energi Indonesia PT 4.45% 05/05/2024	962.889	0,89
<b>ISLAS CAIMÁN</b>				<b>Total de Indonesia</b>					
USD	500.000	CIFI Holdings (Group) 4.38% 12/04/2027	465.588	0,43	USD	1.200.000	Sri Rejeki Isman TBK PT 7.25% 16/01/2025	234.000	0,22
USD	600.000	CIFI Holdings Group Company Limited 6.00% 16/07/2025	600.240	0,56	<b>4.667.748 4,32</b>				
USD	1.000.000	Country Garden Holdings Company Limited 2.70% 12/07/2026	929.374	0,85	<b>JERSEY - ISLAS DEL CANAL</b>				
USD	1.500.000	DP World Salaam Perp FRN	1.647.955	1,53	USD	800.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding Dac 3.05% 23/01/2025	831.378	0,77
USD	500.000	Vale Overseas Limited 6.25% 10/08/2026	591.525	0,55	USD	400.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC 2.60% 16/09/2028	399.000	0,37
<b>Total de Islas Caimán</b>			<b>4.234.682</b>	<b>3,92</b>	<b>Total de Irlanda</b>				
<b>COLOMBIA</b>				<b>1.230.378 1,14</b>					
USD	500.000	Ecopetrol SA 5.88% 18/09/2023	538.975	0,50	<b>JERSEY - ISLAS DEL CANAL</b>				
<b>Total de Colombia</b>			<b>538.975</b>	<b>0,50</b>	USD	1.872.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 1.75% 30/09/2027	1.894.195	1,75
<b>HONG KONG</b>				<b>Total de Jersey - Islas del Canal</b>					
USD	1.800.000	Lenovo Group Limited 5.88% 24/04/2025	2.029.974	1,88	<b>1.894.195 1,75</b>				
<b>Total de Hong Kong</b>			<b>2.029.974</b>	<b>1,88</b>	<b>KAZAJISTÁN</b>				
<b>INDIA</b>				<b>LUXEMBURGO</b>					
USD	500.000	Adani Green Energy Limited 4.38% 08/09/2024	501.351	0,46	USD	500.000	Gazprom PJSC Via Gaz Capital SA 5.15% 11/02/2026	557.838	0,52
USD	500.000	GMR Hyderabad International Airport Limited 5.38% 10/04/2024	512.479	0,47	USD	500.000	MHP Lux SA 6.95% 03/04/2026	533.261	0,49
				USD 1.000.000 MHP SE 7.75% 10/05/2024 1.084.465 1,00					
				USD 1.145.000 Millicom International Cellular SA 4.50% 27/04/2031 1.196.525 1,11					

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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>LUXEMBURGO (continuación)</b>				<b>FILIPINAS (continuación)</b>					
USD	1.000.000	Rumo Luxembourg Sarl 5.25% 10/01/2028	1.051.875	0,97	USD	670.000	Smc Global Power Holdings Corp. Perp FRN	669.795	0,62
<b>Total de Luxemburgo</b>			<b>4.423.964</b>	<b>4,09</b>	<b>Total de Filipinas</b>			<b>1.581.967</b>	<b>1,46</b>
<b>MAURICIO</b>				<b>CATAR</b>					
USD	400.000	Greenko Solar Mauritius Limited 5.55% 29/01/2025	409.571	0,38	USD	2.800.000	Qatar Petroleum 1.38% 12/09/2026	2.779.770	2,57
USD	1.000.000	HTA Group Limited/Mauritius 7.00% 18/12/2025	1.054.500	0,98	<b>Total de Catar</b>			<b>2.779.770</b>	<b>2,57</b>
<b>Total de Mauricio</b>			<b>1.464.071</b>	<b>1,36</b>	<b>ARABIA SAUDÍ</b>				
<b>MÉXICO</b>				<b>SINGAPUR</b>					
USD	500.000	Cemex SAB de CV 5.20% 17/09/2030	541.250	0,50	USD	350.000	Saudi Arabian Oil Company 2.88% 16/04/2024	364.875	0,34
USD	1.000.000	Cemex SAB de CV 7.38% 05/06/2027	1.109.064	1,03	USD	450.000	Saudi Arabian Oil Company 2.88% 16/04/2024	469.125	0,43
USD	1.200.000	Petroleos Mexicanos 4.25% 15/01/2025	1.223.314	1,13	<b>Total de Arabia Saudí</b>			<b>834.000</b>	<b>0,77</b>
USD	1.100.000	Petroleos Mexicanos 6.49% 23/01/2027	1.163.085	1,08	<b>SUDÁFRICA</b>				
USD	800.000	Petroleos Mexicanos 6.88% 16/10/2025	877.000	0,81	USD	520.000	Geo Coal International Pte Limited 8.00% 04/10/2022	533.451	0,49
USD	2.600.000	Petroleos Mexicanos 6.88% 04/08/2026	2.828.378	2,61	<b>Total de Singapur</b>			<b>533.451</b>	<b>0,49</b>
<b>Total de México</b>			<b>7.742.091</b>	<b>7,16</b>	USD	1.400.000	Eskom Holdings 6.75% 06/08/2023	1.445.832	1,33
<b>PAÍSES BAJOS</b>				USD	500.000	Eskom Holdings SOC Limited 7.13% 11/02/2025	521.555	0,48	
USD	925.900	Greenko Dutch BV 3.85% 29/03/2026	942.673	0,87	<b>Total de Sudáfrica</b>			<b>1.967.387</b>	<b>1,81</b>
USD	1.000.000	Syngenta Finance NV 4.44% 24/04/2023	1.046.841	0,97	<b>ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)</b>				
USD	900.000	Syngenta Finance NV 5.18% 24/04/2028	1.014.500	0,94	USD	400.000	Elect Global Investments Limited Perp FRN	408.129	0,38
<b>Total de Países Bajos</b>			<b>3.004.014</b>	<b>2,78</b>	USD	1.700.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 5.13% 15/05/2024	1.833.334	1,70
<b>PERÚ</b>				USD	500.000	State Grid Overseas Investment 2016 Limited 1.00% 05/08/2025	493.682	0,46	
USD	1.000.000	Auna SA 6.50% 20/11/2025	1.050.000	0,97	USD	1.500.000	Studio City Finance Limited 6.00% 15/07/2025	1.490.352	1,38
USD	500.000	Hunt Oil Company of Peru LLC Sucursal del Peru 6.38% 01/06/2028	501.958	0,46	USD	1.133.000	TSMC Global Limited 0.75% 28/09/2025	1.107.521	1,02
<b>Total de Perú</b>			<b>1.551.958</b>	<b>1,43</b>	<b>Total de Islas Vírgenes (Británicas)</b>			<b>5.333.018</b>	<b>4,94</b>
<b>FILIPINAS</b>				<b>Total de bonos</b>				<b>54.396.451</b>	<b>50,29</b>
USD	893.000	Metropolitan Bank & Trust Company 2.13% 15/01/2026	912.172	0,84					

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				
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>							
<b>Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda</b>				<b>Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)</b>							
<b>ANGOLA</b>				<b>EL SALVADOR</b>							
USD	500.000	Angola (Govt of) 8.25% 09/05/2028	519.581	0,48	USD	300.000	El Salvador (Govt of) 7.75% 24/01/2023	254.010	0,23		
USD	1.050.000	Angola (Govt of) 9.50% 12/11/2025	1.160.523	1,07	<b>Total de El Salvador</b>			<b>254.010</b>	<b>0,23</b>		
<b>Total de Angola</b>				<b>1.680.104</b>	<b>1,55</b>						
<b>BIELORRUSIA</b>				<b>GHANA</b>							
USD	1.202.000	Belarus (Govt of) 6.88% 28/02/2023	1.223.524	1,13	USD	1.162.000	Ghana (Govt of) 0.00% 07/04/2025	894.043	0,83		
<b>Total de Bielorrusia</b>				<b>1.223.524</b>	<b>1,13</b>	USD	2.700.000	Ghana (Govt of) 6.38% 11/02/2027	2.531.318	2,34	
				<b>Total de Ghana</b>				<b>3.425.361</b>	<b>3,17</b>		
<b>BRASIL</b>				<b>GUATEMALA</b>							
USD	3.400.000	Brazil (Govt of) 4.25% 07/01/2025	3.664.583	3,39	USD	745.000	Guatemala (Govt of) 5.75% 06/06/2022	763.772	0,71		
<b>Total de Brasil</b>				<b>3.664.583</b>	<b>3,39</b>	<b>Total de Guatemala</b>				<b>763.772</b>	<b>0,71</b>
<b>COLOMBIA</b>				<b>INDONESIA</b>							
USD	1.300.000	Colombia (Govt of) 4.00% 26/02/2024	1.360.925	1,26	USD	250.000	Indonesia (Govt of) 4.13% 15/01/2025	273.972	0,25		
<b>Total de Colombia</b>				<b>1.360.925</b>	<b>1,26</b>	<b>Total de Indonesia</b>				<b>273.972</b>	<b>0,25</b>
<b>COSTA RICA</b>				<b>NIGERIA</b>							
USD	300.000	Costa Rica (Govt of) 4.38% 30/04/2025	305.392	0,28	USD	580.000	Nigeria (Govt of) 7.63% 21/11/2025	643.630	0,60		
<b>Total de Costa Rica</b>				<b>305.392</b>	<b>0,28</b>	<b>Total de Nigeria</b>				<b>643.630</b>	<b>0,60</b>
<b>REPÚBLICA DOMINICANA</b>				<b>OMÁN</b>							
USD	1.700.000	Dominican Republic (Govt of) 5.50% 27/01/2025	1.856.329	1,72	USD	1.000.000	Oman (Govt of) 4.40% 01/06/2024	1.034.357	0,96		
USD	1.000.000	Dominican Republic (Govt of) 5.88% 18/04/2024	1.060.071	0,98	USD	1.700.000	Oman (Govt of) 4.75% 15/06/2026	1.746.611	1,62		
DOP	52.000.000	Dominican Republic (Govt of) 16.95% 04/02/2022	965.348	0,89	<b>Total de Omán</b>				<b>2.780.968</b>	<b>2,58</b>	
<b>Total de República Dominicana</b>				<b>3.881.748</b>	<b>3,59</b>						
<b>EGIPTO</b>				<b>PAKISTÁN</b>							
USD	700.000	Egypt (Govt of) 3.88% 16/02/2026	657.335	0,61	USD	800.000	Pakistan (Govt of) 6.00% 08/04/2026	797.826	0,74		
USD	1.750.000	Egypt (Govt of) 5.25% 06/10/2025	1.788.181	1,65	USD	346.000	Pakistan (Govt of) 8.25% 30/09/2025	376.457	0,35		
USD	2.000.000	Egypt (Govt of) 5.75% 29/05/2024	2.084.732	1,93	<b>Total de Pakistán</b>				<b>1.174.283</b>	<b>1,09</b>	
USD	1.300.000	Egypt (Govt of) 5.88% 11/06/2025	1.345.500	1,24							
<b>Total de Egipto</b>				<b>5.875.748</b>	<b>5,43</b>						

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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)</b>				<b>Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)</b>					
<b>PANAMÁ</b>				<b>UCRANIA (continuación)</b>					
USD	1.350.000	Panama (Govt of) 3.75% 16/03/2025	1.450.434	1,34	USD	700.000	Ukraine (Govt of) 7.75% 01/09/2026	758.977	0,70
<b>Total de Panamá</b>			<b>1.450.434</b>	<b>1,34</b>	<b>Total de Ucrania</b>			<b>2.649.031</b>	<b>2,44</b>
<b>CATAR</b>				<b>Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda</b>					
USD	2.700.000	Qatar (Govt of) 3.25% 02/06/2026	2.923.882	2,70	<b>45.819.565</b>				
<b>Total de Catar</b>			<b>2.923.882</b>	<b>2,70</b>	<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				
<b>FEDERACIÓN RUSA</b>				<b>100.216.016</b>					
USD	800.000	Russia (Govt of) 4.75% 27/05/2026	902.474	0,83	<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente</b>				
<b>Total de la Federación Rusa</b>			<b>902.474</b>	<b>0,83</b>	<b>Bonos</b>				
<b>SUDÁFRICA</b>				<b>BERMUDAS</b>					
USD	350.000	South Africa (Govt of) 4.85% 30/09/2029	360.537	0,33	USD	1.000.000	Tengizchevroil Finance Company International 2.63% 15/08/2025	1.022.250	0,95
USD	600.000	South Africa (Govt of) 4.88% 14/04/2026	643.371	0,59	<b>Total de Bermudas</b>			<b>1.022.250</b>	<b>0,95</b>
<b>Total de Sudáfrica</b>			<b>1.003.908</b>	<b>0,92</b>	<b>Total de bonos</b>				
<b>TURQUÍA</b>				<b>1.022.250</b>					
USD	1.000.000	Turkey (Govt of) 3.25% 23/03/2023	996.921	0,92	<b>Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda</b>				
USD	900.000	Turkey (Govt of) 4.75% 26/01/2026	870.925	0,81	<b>EGIPTO</b>				
USD	1.673.000	Turkey (Govt of) 5.60% 14/11/2024	1.696.793	1,57	EGP	18.150.000	Egypt (Govt of) 0.00% 23/11/2021	1.134.595	1,05
USD	4.100.000	Turkey (Govt of) 5.75% 22/03/2024	4.212.955	3,91	<b>Total de Egipto</b>			<b>1.134.595</b>	<b>1,05</b>
USD	1.700.000	Turkey (Govt of) 7.38% 05/02/2025	1.804.222	1,67	<b>Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda</b>				
<b>Total de Turquía</b>			<b>9.581.816</b>	<b>8,88</b>	<b>1.134.595</b>				
<b>UCRANIA</b>				<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente</b>					
USD	650.000	Ukraine (Govt of) 7.75% 01/09/2023	696.563	0,64	<b>2.156.845</b>				
USD	1.100.000	Ukraine (Govt of) 7.75% 01/09/2024	1.193.491	1,10	<b>2,00</b>				

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
<b>Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario</b>			
<b>Bonos</b>			
<b>VENEZUELA</b>			
USD	3.288.783	Petroleos de Venezuela SA 6.00% 16/05/2024	193.216 0,18
USD	491.751	Petroleos de Venezuela SA 6.00% 15/11/2026	28.890 0,03
	<b>Total de Venezuela</b>	<b>222.106</b>	<b>0,21</b>
<b>Total de bonos</b>		<b>222.106</b>	<b>0,21</b>
<b>Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda</b>			
<b>VENEZUELA</b>			
USD	1.245.400	Venezuela (Govt of) 8.25% 13/10/2024	133.818 0,12
	<b>Total de Venezuela</b>	<b>133.818</b>	<b>0,12</b>
<b>Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda</b>		<b>133.818</b>	<b>0,12</b>
<b>Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario</b>		<b>355.924</b>	<b>0,33</b>
<b>Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>			
<b>Fondos</b>			
<b>IRLANDA</b>			
	870.919	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	870.919 0,81
	<b>Total de Irlanda</b>	<b>870.919</b>	<b>0,81</b>
<b>Total de fondos</b>		<b>870.919</b>	<b>0,81</b>
<b>Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>		<b>870.919</b>	<b>0,81</b>
<b>Valor total de las inversiones</b>		<b>103.599.704</b>	<b>95,80</b>
<b>(Coste total: 104.104.870 USD)</b>			

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

### Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2021

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Bonos</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>CANADÁ</b>				<b>PAÍSES BAJOS (continuación)</b>					
USD	203.000	Bausch Health Cos Inc. 7.00% 15/01/2028	208.395	0,11	USD	458.000	Ziggo BV 4.88% 15/01/2030	472.599	0,25
USD	494.000	Bombardier Inc. 7.88% 15/04/2027	512.439	0,27	<b>Total de Países Bajos</b>				
USD	202.000	Nova Chemicals Corp. 4.25% 15/05/2029	201.832	0,11	<b>1.616.248 0,85</b>				
<b>Total de Canadá</b>				<b>0,49</b>					
<b>FRANCIA</b>				<b>PANAMÁ</b>					
USD	504.000	Altice France SA 5.13% 15/07/2029	495.694	0,26	USD	342.000	Carnival Corp. 7.63% 01/03/2026	365.299	0,19
USD	311.000	Altice France SA 5.50% 15/01/2028	316.979	0,17	<b>Total de Panamá</b>				
USD	581.000	Altice France SA 8.13% 01/02/2027	626.245	0,33	<b>365.299 0,19</b>				
<b>Total de Francia</b>				<b>0,76</b>					
<b>ALEMANIA</b>				<b>SUPRANACIONAL</b>					
USD	384.000	Iho Verwaltungs GmbH 6.38% 15/05/2029	420.480	0,22	USD	488.000	Ardagh Packaging Finance plc 5.25% 15/08/2027	497.760	0,26
USD	261.000	IHO Verwaltungs GmbH 4.75% 15/09/2026	267.688	0,14	<b>Total de supranacional</b>				
<b>Total de Alemania</b>				<b>497.760 0,26</b>					
<b>LIBERIA</b>				<b>ESTADOS UNIDOS</b>					
USD	453.000	Royal Caribbean Cruises Limited 3.70% 15/03/2028	435.729	0,23	USD	58.000	Allegheny Technologies Inc. 4.88% 01/10/2029	58.269	0,03
USD	147.000	Royal Caribbean Cruises Limited 5.25% 15/11/2022	151.067	0,08	USD	415.000	Allegheny Technologies Inc. 5.13% 01/10/2031	418.455	0,22
USD	402.000	Royal Caribbean Cruises Limited 5.50% 01/04/2028	411.760	0,22	USD	182.000	American Axle & Manufacturing Inc. 6.25% 15/03/2026	187.752	0,10
<b>Total Liberia</b>				<b>0,53</b>					
<b>LUXEMBURGO</b>				<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>					
USD	455.000	Herens Holdco Sarl 4.75% 15/05/2028	457.844	0,24	USD	191.000	American Axle & Manufacturing Inc. 6.50% 01/04/2027	199.257	0,11
<b>Total de Luxemburgo</b>				<b>0,24</b>					
<b>PAÍSES BAJOS</b>				<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>					
USD	375.000	Trivium Packaging Finance BV 5.50% 15/08/2026	394.082	0,21	USD	106.000	Apache Corp. 4.63% 15/11/2025	114.149	0,06
USD	178.000	Trivium Packaging Finance BV 8.50% 15/08/2027	190.476	0,10	USD	744.000	Apache Corp. 4.75% 15/04/2043	806.481	0,43
USD	539.000	Ziggo Bond Finance BV 6.00% 15/01/2027	559.091	0,29	USD	405.000	Apache Corp. 4.88% 15/11/2027	441.914	0,23
<b>PAÍSES BAJOS (continuación)</b>				<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>					
USD	375.000	Trivium Packaging Finance BV 5.50% 15/08/2026	394.082	0,21	USD	275.000	Apache Corp. 5.10% 01/09/2040	348.897	0,18
USD	178.000	Trivium Packaging Finance BV 8.50% 15/08/2027	190.476	0,10	USD	183.000	Bath & Body Works Inc. 5.25% 01/02/2028	201.968	0,11
USD	539.000	Ziggo Bond Finance BV 6.00% 15/01/2027	559.091	0,29	USD	243.000	Bath & Body Works Inc. 6.88% 01/11/2035	303.978	0,16
<b>PAÍSES BAJOS (continuación)</b>				<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>					
USD	375.000	Trivium Packaging Finance BV 5.50% 15/08/2026	394.082	0,21	USD	221.000	Bath & Body Works Inc. 7.50% 15/06/2029	252.321	0,13
USD	178.000	Trivium Packaging Finance BV 8.50% 15/08/2027	190.476	0,10	USD	221.000	Cedar Fair LP 5.38% 01/06/2024	223.420	0,12
USD	539.000	Ziggo Bond Finance BV 6.00% 15/01/2027	559.091	0,29	USD	285.000	Centene Corp. 2.63% 01/08/2031	283.375	0,15
<b>PAÍSES BAJOS (continuación)</b>				<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>					
USD	375.000	Trivium Packaging Finance BV 5.50% 15/08/2026	394.082	0,21	USD	507.000	Centene Corp. 3.00% 15/10/2030	520.309	0,27
USD	178.000	Trivium Packaging Finance BV 8.50% 15/08/2027	190.476	0,10	USD	571.000	DCP Midstream Operating LP 5.13% 15/05/2029	644.338	0,34
USD	539.000	Ziggo Bond Finance BV 6.00% 15/01/2027	559.091	0,29	USD	186.000	DCP Midstream Operating LP 5.60% 01/04/2044	217.155	0,11
<b>PAÍSES BAJOS (continuación)</b>				<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>					
USD	375.000	Trivium Packaging Finance BV 5.50% 15/08/2026	394.082	0,21	USD	482.000	Delta Air Lines Inc. 7.38% 15/01/2026	566.139	0,30
USD	178.000	Trivium Packaging Finance BV 8.50% 15/08/2027	190.476	0,10	USD	142.000	Encompass Health Corp. 4.50% 01/02/2028	147.603	0,08
USD	539.000	Ziggo Bond Finance BV 6.00% 15/01/2027	559.091	0,29	USD	349.000	EQM Midstream Partner LP 5.50% 15/07/2028	384.264	0,20

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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>				<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>					
USD	193.000	EQT Corp. 3.90% 01/10/2027	209.164	0,11	USD	335.000	Lumen Technologies Inc. 7.50% 01/04/2024	371.549	0,20
USD	250.000	EQT Corp. 5.00% 15/01/2029	282.188	0,15					
USD	438.000	EQT Corp. 8.50% 01/02/2030	564.577	0,30	USD	279.000	Mgic Investment Corp. 5.25% 15/08/2028	297.931	0,16
USD	159.000	FirstEnergy Corp. 5.60% 15/07/2047	194.103	0,10	USD	201.000	Navient Corp. 4.88% 15/03/2028	202.884	0,11
USD	140.000	FirstEnergy Corp. 7.38% 15/11/2031	190.847	0,10	USD	214.000	Navient Corp. 5.50% 25/01/2023	224.031	0,12
USD	182.000	Ford Motor Company 4.75% 15/01/2043	191.713	0,10	USD	202.000	Navient Corp. 6.75% 25/06/2025	221.467	0,12
USD	155.000	Ford Motor Company 7.45% 16/07/2031	202.729	0,11	USD	199.000	Netflix Inc. 4.88% 15/04/2028	229.615	0,12
USD	142.000	Ford Motor Company 8.50% 21/04/2023	156.458	0,08	USD	352.000	Netflix Inc. 5.88% 15/11/2028	431.561	0,23
USD	216.000	Ford Motor Company 9.00% 22/04/2025	259.875	0,14	USD	226.000	NRG Energy Inc. 6.63% 15/01/2027	234.299	0,12
USD	119.000	Ford Motor Company 9.63% 22/04/2030	168.585	0,09	USD	222.000	Nustar Logistics LP 5.75% 01/10/2025	240.097	0,13
USD	1.206.000	Ford Motor Credit Company 4.39% 08/01/2026	1.290.524	0,68	USD	196.000	Nustar Logistics LP 6.38% 01/10/2030	217.735	0,11
USD	385.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.70% 10/08/2026	386.375	0,20	USD	151.000	NuStar Logistics LP 5.63% 28/04/2027	161.442	0,09
USD	257.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.90% 16/02/2028	255.463	0,13	USD	578.000	NuStar Logistics LP 6.00% 01/06/2026	627.116	0,33
USD	402.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.38% 13/11/2025	414.372	0,22	USD	956.000	Occidental Petroleum Corp. 3.50% 15/08/2029	971.937	0,51
USD	771.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.66% 08/09/2024	799.596	0,42	USD	996.000	Occidental Petroleum Corp. 4.40% 15/04/2046	993.668	0,52
USD	103.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.00% 13/11/2030	107.200	0,06	USD	115.000	Occidental Petroleum Corp. 4.40% 15/08/2049	113.203	0,06
USD	58.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.13% 17/08/2027	61.581	0,03	USD	356.000	Occidental Petroleum Corp. 6.13% 01/01/2031	426.533	0,23
USD	88.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.14% 15/02/2023	90.448	0,05	USD	417.000	Occidental Petroleum Corp. 6.63% 01/09/2030	514.734	0,27
USD	358.000	Ford Motor Credit Company LLC 5.11% 03/05/2029	400.960	0,21	USD	156.000	Occidental Petroleum Corp. 6.63% 01/09/2030	192.563	0,10
USD	663.000	Freeport-McMoran Inc. 5.45% 15/03/2043	817.777	0,44	USD	163.000	Occidental Petroleum Corp. 7.50% 01/05/2031	212.169	0,11
USD	352.000	Freeport-McMoRan Inc. 5.25% 01/09/2029	383.020	0,20	USD	288.000	OneMain Finance Corp. 5.63% 15/03/2023	303.088	0,16
USD	372.000	HB Fuller Company 4.25% 15/10/2028	379.208	0,20	USD	216.000	OneMain Finance Corp. 6.13% 15/03/2024	230.758	0,12
USD	201.000	HCA Inc. 3.50% 01/09/2030	213.314	0,11	USD	189.000	OneMain Finance Corp. 6.88% 15/03/2025	212.251	0,11
USD	473.000	HCA Inc. 5.63% 01/09/2028	563.050	0,30	USD	234.000	OneMain Finance Corp. 7.13% 15/03/2026	271.294	0,14
USD	336.000	HCA Inc. 5.88% 01/02/2029	404.817	0,21	USD	220.000	PG&E Corp. 5.00% 01/07/2028	224.400	0,12
USD	197.000	Kraft Heinz Foods Company 4.38% 01/06/2046	224.826	0,12	USD	471.000	Primo Water Holdings Inc. 4.38% 30/04/2029	470.093	0,25
USD	340.000	Kraft Heinz Foods Company 4.88% 01/10/2049	414.375	0,22	USD	146.000	Radian Group Inc. 4.88% 15/03/2027	159.418	0,08
USD	518.000	Kraft Heinz Foods Company 5.20% 15/07/2045	651.400	0,34	USD	212.000	Radian Group Inc. 6.63% 15/03/2025	237.672	0,13
					USD	138.000	Service Properties Trust 4.35% 01/10/2024	139.998	0,07

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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos</b>					
<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>				<b>BERMUDAS</b>					
USD	187.000	Service Properties Trust 4.65% 15/03/2024	189.714	0,10	USD	182.000	Nabors Industries Limited 7.25% 15/01/2026	177.696	0,09
USD	181.000	SM Energy Company 6.50% 15/07/2028	187.361	0,10	USD	246.000	NCL Corp. Limited 5.88% 15/03/2026	252.458	0,13
USD	473.000	SM Energy Company 6.75% 15/09/2026	484.252	0,25	USD	126.000	Ncl Finance Limited 6.13% 15/03/2028	131.225	0,07
USD	175.000	Sprint Capital Corp. 8.75% 15/03/2032	261.863	0,14	<b>Total de Bermudas</b>			<b>561.379</b>	<b>0,29</b>
USD	665.000	Sprint Corp. 7.63% 15/02/2025	778.203	0,40	<b>CANADÁ</b>				
USD	303.000	Sprint Corp. 7.63% 01/03/2026	367.421	0,19	USD	570.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc. 3.88% 15/01/2028	576.028	0,30
USD	389.000	Targa Resources Partners LP 5.88% 15/04/2026	406.991	0,21	USD	425.000	Air Canada 3.88% 15/08/2026	429.781	0,23
USD	378.000	T-Mobile USA Inc. 2.63% 15/02/2029	381.991	0,20	USD	161.000	Bausch Health Cos Inc. 4.88% 01/06/2028	166.990	0,09
USD	458.000	T-Mobile USA Inc. 3.50% 15/04/2031	484.250	0,26	USD	364.000	Bausch Health Cos Inc. 5.00% 30/01/2028	345.562	0,18
USD	704.000	T-Mobile USA Inc. 3.50% 15/04/2031	743.394	0,39	USD	395.000	Bausch Health Cos Inc. 5.25% 30/01/2030	368.831	0,19
USD	361.000	T-Mobile USA Inc. 4.75% 01/02/2028	383.788	0,20	USD	440.000	Bausch Health Cos Inc. 5.50% 01/11/2025	447.425	0,24
USD	601.000	TransDigm Inc. 5.50% 15/11/2027	618.279	0,33	USD	447.000	Bausch Health Cos Inc. P.P. 144A 6.13% 15/04/2025	456.923	0,24
USD	422.000	TransDigm Inc. 6.38% 15/06/2026	436.257	0,23	USD	103.000	Clarios Global LP 6.75% 15/05/2025	109.077	0,06
USD	404.000	TRI Pointe Group Inc. 5.88% 15/06/2024	445.412	0,23	USD	390.000	Gfl Environmental Inc. 3.75% 01/08/2025	401.944	0,21
USD	501.000	United Airlines Inc. 4.63% 15/04/2029	517.679	0,27	USD	334.000	Gfl Environmental Inc. 4.00% 01/08/2028	332.121	0,18
USD	147.000	United Rentals North America Inc. 5.50% 15/05/2027	154.521	0,08	USD	127.000	Gfl Environmental Inc. 4.25% 01/06/2025	131.189	0,07
USD	332.000	Vistra Operations Company LLC 4.38% 01/05/2029	333.828	0,18	USD	195.000	GFL Environmental Inc. 3.50% 01/09/2028	196.036	0,10
USD	169.000	Welbilt Inc. 9.50% 15/02/2024	173.909	0,09	USD	381.000	GFL Environmental Inc. 4.75% 15/06/2029	391.478	0,21
USD	568.000	Western Midstream Operating LP 4.65% 01/07/2026	614.708	0,32	USD	265.000	GFL Environmental Inc. 5.13% 15/12/2026	278.736	0,15
USD	64.000	Western Midstream Operating LP 4.75% 15/08/2028	69.982	0,04	USD	292.000	Hudbay Minerals Inc. 4.50% 01/04/2026	290.279	0,15
USD	329.000	Western Midstream Operating LP 5.05% 01/02/2030	364.098	0,19	USD	213.000	Hudbay Minerals Inc. 6.13% 01/04/2029	222.862	0,12
USD	170.000	Western Midstream Operating LP 5.30% 01/03/2048	196.138	0,10	USD	182.000	Nova Chemicals Corp. 5.25% 01/06/2027	191.674	0,10
<b>Total de Estados Unidos</b>		<b>34.631.728</b>	<b>18,23</b>		USD	365.000	Rockpoint Gas Storage Canada Limited 7.00% 31/03/2023	371.844	0,20
<b>Total de bonos</b>		<b>41.617.187</b>	<b>21,91</b>		USD	617.000	Videotron Limited 3.63% 15/06/2029	627.416	0,33
<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>		<b>41.617.187</b>	<b>21,91</b>		<b>Total de Canadá</b>			<b>6.336.196</b>	<b>3,35</b>

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			
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)</b>						
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>						
<b>ISLAS CAIMÁN</b>				<b>LUXEMBURGO (continuación)</b>						
USD	601.627	Hawaiian Brand Intellectual Property Limited 5.75% 20/01/2026	631.369	0,33	USD	440.000	Ion Trading Technologies Sarl 5.75% 15/05/2028	452.650	0,24	
USD	563.330	Transocean Sentry Limited 5.38% 15/05/2023	556.288	0,29	<b>Total de Luxemburgo</b>			<b>2.817.805</b>	<b>1,48</b>	
<b>Total de Islas Caimán</b>				<b>1.187.657</b>	<b>0,62</b>	<b>PAÍSES BAJOS</b>				
<b>FRANCIA</b>				<b>PANAMÁ</b>						
USD	558.000	Constellium SE 3.75% 15/04/2029	544.748	0,29	USD	383.000	Alcoa Nederland Holding BV 4.13% 31/03/2029	400.373	0,21	
USD	578.000	Constellium SE 5.63% 15/06/2028	606.507	0,32	USD	187.000	Clear Channel International BV 6.63% 01/08/2025	195.236	0,10	
USD	37.000	SPCM SA 3.13% 15/03/2027	37.092	0,02	USD	443.000	Constellium NV 5.88% 15/02/2026	450.659	0,24	
<b>Total de Francia</b>				<b>1.188.347</b>	<b>0,63</b>	USD	751.000	Ziggo BV 5.50% 15/01/2027	776.816	0,41
<b>IRLANDA</b>				<b>Total de Países Bajos</b>				<b>1.823.084</b>	<b>0,96</b>	
USD	504.000	James Hardie International Finance DAC 5.00% 15/01/2028	530.530	0,28	<b>PANAMÁ</b>					
<b>Total de Irlanda</b>				<b>530.530</b>	<b>0,28</b>	USD	649.000	Carnival Corp. 4.00% 01/08/2028	656.513	0,35
<b>LIBERIA</b>				<b>SUPRANACIONAL</b>						
USD	306.000	Royal Caribbean Cruises Limited 4.25% 01/07/2026	300.112	0,16	USD	132.000	Ardagh Packaging Finance plc 4.13% 15/08/2026	137.181	0,07	
USD	104.000	Royal Caribbean Cruises Limited 5.50% 31/08/2026	106.906	0,06	USD	207.000	Clarios Global LP 6.25% 15/05/2026	217.743	0,11	
USD	186.000	Royal Caribbean Cruises Limited 9.13% 15/06/2023	202.843	0,11	USD	403.000	Clarios Global LP 8.50% 15/05/2027	429.132	0,23	
USD	102.000	Royal Caribbean Cruises Limited 11.50% 01/06/2025	116.446	0,06	<b>Total de supranacional</b>			<b>784.056</b>	<b>0,41</b>	
<b>Total Liberia</b>				<b>726.307</b>	<b>0,39</b>	<b>REINO UNIDO</b>				
<b>LUXEMBURGO</b>				<b>REINO UNIDO</b>						
USD	516.000	Altice France Holding SA 6.00% 15/02/2028	495.928	0,26	USD	215.000	International Game Technology plc 4.13% 15/04/2026	223.020	0,12	
USD	327.000	Altice France Holding SA 10.50% 15/05/2027	357.812	0,19	USD	313.000	International Game Technology plc P.P. 144A 6.50% 15/02/2025	349.684	0,18	
USD	477.000	Camelot Finance SA 4.50% 01/11/2026	496.065	0,26	USD	405.000	Virgin Media Finance plc 5.00% 15/07/2030	414.410	0,22	
USD	99.000	Endo Dac Endo Finance LLC 9.50% 31/07/2027	99.325	0,05	USD	282.000	Virgin Media Secured Finance plc 4.50% 15/08/2030	285.173	0,15	
USD	209.000	Endo Finance Company LLC 6.00% 30/06/2028	149.566	0,08	USD	753.000	Vmed O2 UK Financing I plc 4.75% 15/07/2031	770.865	0,41	
USD	744.000	Fage International 5.63% 15/08/2026	766.459	0,40	<b>Total del Reino Unido</b>			<b>2.043.152</b>	<b>1,08</b>	

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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>ESTADOS UNIDOS</b>				<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>					
USD	322.000	Acadia Healthcare Company Inc. 5.00% 15/04/2029	336.439	0,18	USD	47.000	Bath & Body Works Inc. 9.38% 01/07/2025	59.854	0,03
USD	221.000	Acadia Healthcare Company Inc. 5.50% 01/07/2028	232.868	0,12	USD	526.000	Bausch Health Americas Inc. 9.25% 01/04/2026	562.746	0,30
USD	720.000	AdaptHealth LLC 5.13% 01/03/2030	720.530	0,38	USD	298.000	Beacon Roofing Supply Inc. 4.13% 15/05/2029	297.255	0,16
USD	101.000	Advisor Group Holdings Inc. 10.75% 01/08/2027	111.623	0,06	USD	306.000	Beacon Roofing Supply Inc. 4.50% 15/11/2026	318.623	0,17
USD	118.000	AG Issuer LLC 6.25% 01/03/2028	123.895	0,07	USD	202.000	Black Knight Infoserv LLC 3.63% 01/09/2028	203.681	0,11
USD	300.000	Albertsons Companies Inc. 3.25% 15/03/2026	305.833	0,16	USD	497.000	Blackstone Mortgage Trust Inc. 3.75% 15/01/2027	493.894	0,26
USD	487.000	Albertsons Companies Inc. 5.88% 15/02/2028	519.264	0,27	USD	234.000	Boxer Parent Company Inc. 7.13% 02/10/2025	250.139	0,13
USD	333.000	Alliant Holdings Intermediate LLC 4.25% 15/10/2027	338.865	0,18	USD	207.000	Boyd Gaming Corp. 4.75% 01/12/2027	213.743	0,11
USD	568.000	Alliant Holdings Intermediate LLC 6.75% 15/10/2027	590.012	0,31	USD	463.000	Boyd Gaming Corp. 4.75% 15/06/2031	477.339	0,26
USD	775.000	American Airlines Inc. 5.50% 20/04/2026	816.172	0,43	USD	93.000	Boyd Gaming Corp. 8.63% 01/06/2025	101.079	0,05
USD	574.908	American Airlines Inc. 5.75% 20/04/2029	619.823	0,33	USD	454.000	BroadStreet Partners Inc. 5.88% 15/04/2029	454.568	0,24
USD	412.000	American Airlines Inc. 11.75% 15/07/2025	510.308	0,27	USD	291.000	BWV Technologies Inc. 4.13% 30/06/2028	299.003	0,16
USD	619.000	American Builders & Contractors Supply Company Inc. 4.00% 15/01/2028	632.448	0,34	USD	199.000	Cablevision Lightpath LLC 3.88% 15/09/2027	195.831	0,10
USD	121.000	APX Group Inc. 6.75% 15/02/2027	128.620	0,07	USD	292.000	Cablevision Lightpath LLC 5.63% 15/09/2028	292.926	0,15
USD	87.000	Aramark Se 6.38% 01/05/2025	91.661	0,05	USD	643.000	Caesars Entertainment Inc. 4.63% 15/10/2029	651.841	0,34
USD	148.000	Arches Buyer Inc. 4.25% 01/06/2028	150.242	0,08	USD	604.000	Caesars Entertainment Inc. 6.25% 01/07/2025	636.862	0,34
USD	303.000	Arches Buyer Inc. 6.13% 01/12/2028	308.871	0,16	USD	583.000	Caesars Entertainment Inc. 8.13% 01/07/2027	655.874	0,35
USD	257.000	Archrock Partners LP Archrock Partners Finance Corp. 6.25% 01/04/2028	265.882	0,15	USD	756.000	Caesars Resort Collection LLC 5.25% 15/10/2025	767.556	0,40
USD	739.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 4.00% 01/09/2029	747.106	0,40	USD	302.000	Caesars Resort Collection LLC 5.75% 01/07/2025	318.233	0,17
USD	182.000	Aretec Escrow Issuer Inc. 7.50% 01/04/2029	187.371	0,10	USD	1.182.000	Callon Petroleum Company 6.38% 01/07/2026	1.133.242	0,60
USD	358.000	Assuredpartners Inc. 5.63% 15/01/2029	360.443	0,19	USD	195.000	Callon Petroleum Company 8.00% 01/08/2028	192.806	0,10
USD	584.000	Avantor Funding Inc. 4.63% 15/07/2028	615.432	0,32	USD	140.000	Calpine Corp. 4.50% 15/02/2028	142.888	0,08
USD	314.000	Axalta Coating Systems LLC 3.38% 15/02/2029	305.436	0,16	USD	204.000	Catalent Pharma Solutions 3.13% 15/02/2029	199.682	0,11
USD	251.000	Bath & Body Works Inc. 6.63% 01/10/2030	284.136	0,15	USD	230.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 3.50% 01/04/2030	230.144	0,12
					USD	182.000	CCM Merger Inc. 6.38% 01/05/2026	192.010	0,10

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.



## Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

### Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>				<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>					
USD	343.000	CCO Holdings LCC 5.13% 01/05/2027	357.598	0,19	USD	577.000	Chscommunity Health 6.63% 15/02/2025	604.408	0,32
USD	983.000	Cco Holdings LLC 4.25% 01/02/2031	1.000.669	0,53	USD	592.000	Cinemark USA Inc. 5.25% 15/07/2028	584.230	0,31
USD	188.000	CCO Holdings LLC 4.50% 01/05/2032	193.758	0,10	USD	314.000	Cinemark USA Inc. 8.75% 01/05/2025	338.356	0,18
USD	1.090.000	CCO Holdings LLC 4.75% 01/03/2030	1.140.249	0,59	USD	267.000	Clarivate Science Holdings Corp. 3.88% 01/07/2028	267.167	0,14
USD	733.000	CCO Holdings LLC 5.00% 01/02/2028	766.553	0,40	USD	562.000	Clarivate Science Holdings Corp. 4.88% 01/07/2029	563.855	0,30
USD	488.000	CD&R Smokey Buyer Inc. 6.75% 15/07/2025	517.095	0,28	USD	362.000	Clear Channel Outdoor Holdings Inc. 7.50% 01/06/2029	377.485	0,21
USD	244.000	Cedar Fair LP Canada's Wonderland Company 5.50% 01/05/2025	254.618	0,13	USD	647.000	Clear Channel Worldwide 7.75% 15/04/2028	680.765	0,36
USD	272.000	Cedar Fair LP Canada's Wonderland Company Magnum Management Corp. Millennium Op 6.50% 01/10/2028	292.232	0,15	USD	575.000	Clear Channel Worldwide Holdings Inc. 5.13% 15/08/2027	595.735	0,31
USD	527.000	Cengage Learning Inc. 9.50% 15/06/2024	541.269	0,29	USD	689.000	Clearway Energy Operating LLC 3.75% 15/02/2031	695.364	0,36
USD	221.000	Centene Corp. 3.38% 15/02/2030	229.216	0,12	USD	173.000	Clearway Energy Operating LLC 3.75% 15/01/2032	173.216	0,09
USD	270.000	Centene Corp. 4.63% 15/12/2029	294.584	0,16	USD	319.000	Clearway Energy Operating LLC 4.75% 15/03/2028	338.019	0,18
USD	217.000	ChampionX Corp. 6.38% 01/05/2026	227.036	0,12	USD	373.000	CNX Midstream Partners LP 4.75% 15/04/2030	378.129	0,20
USD	159.000	Charles River Laboratories International Inc. 3.75% 15/03/2029	163.044	0,09	USD	317.000	Cnx Resources Corp. 6.00% 15/01/2029	335.228	0,18
USD	127.000	Charles River Laboratories International Inc. 4.00% 15/03/2031	133.003	0,07	USD	437.000	Cnx Resources Corp. 7.25% 14/03/2027	466.093	0,25
USD	111.000	Charles River Laboratories International Inc. 4.25% 01/05/2028	115.371	0,06	USD	145.000	Colfax Corp 6.38% 15/02/2026	152.530	0,08
USD	455.000	Cheniere Energy Inc. 4.63% 15/10/2028	479.684	0,25	USD	274.000	CommScope Technologies LLC P.P. 144A 6.00% 15/06/2025	278.335	0,15
USD	247.000	Cheniere Energy Partners 4.00% 01/03/2031	259.379	0,14	USD	212.000	Comstock Resources Inc. 6.75% 01/03/2029	229.119	0,12
USD	775.000	Cheniere Energy Partners LP 3.25% 31/01/2032	781.054	0,41	USD	245.000	CP Atlas Buyer Inc. 7.00% 01/12/2028	247.002	0,13
USD	290.000	Cheniere Energy Partners LP 4.50% 01/10/2029	309.031	0,16	USD	404.000	Crownrock LP 5.63% 15/10/2025	414.353	0,22
USD	123.000	CHS - Community Health Systems 5.63% 15/03/2027	128.950	0,07	USD	190.000	CrownRock LP 5.00% 01/05/2029	199.149	0,11
USD	275.000	CHS - Community Health Systems 6.88% 15/04/2029	276.011	0,15	USD	451.000	CSC Holdings LLC 3.38% 15/02/2031	419.994	0,22
USD	305.000	CHS - Community Health Systems 8.00% 15/03/2026	323.564	0,17	USD	420.000	CSC Holdings LLC 4.13% 01/12/2030	412.125	0,22
					USD	319.000	CSC Holdings LLC 4.63% 01/12/2030	302.682	0,16
					USD	330.000	CSC Holdings LLC 5.00% 15/11/2031	316.701	0,17
					USD	207.000	CSC Holdings LLC 5.38% 01/02/2028	216.444	0,11
					USD	614.000	CSC Holdings LLC 6.50% 01/02/2029	665.079	0,35

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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>				<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>					
USD	256.000	DCP Midstream Operating LP 5.63% 15/07/2027	291.520	0,15	USD	486.000	Helios Software Holdings Inc. 4.63% 01/05/2028	481.487	0,25
USD	189.000	Delek Logistics Partners LP 6.75% 15/05/2025	193.631	0,10	USD	381.000	Herc Holdings Inc. 5.50% 15/07/2027	400.169	0,21
USD	324.000	Delta Air Lines Inc. 4.50% 20/10/2025	347.571	0,18	USD	127.000	Hess Midstream Operations LP 4.25% 15/02/2030	128.508	0,07
USD	442.000	Delta Air Lines Inc. 4.75% 20/10/2028	493.935	0,26	USD	465.000	Hightower Holding LLC 6.75% 15/04/2029	477.424	0,25
USD	178.000	Delta Air Lines Inc. 7.00% 01/05/2025	208.060	0,11	USD	373.000	Hilcorp Energy I LP 5.75% 01/02/2029	384.773	0,20
USD	99.000	Diamond Sports Group LLC 5.38% 15/08/2026	65.588	0,03	USD	113.000	Hilton Domestic Operating Company Inc. 5.38% 01/05/2025	118.194	0,06
USD	245.000	Diamond Sports Group LLC 6.63% 15/08/2027	108.771	0,06	USD	125.000	Hilton Domestic Operating Company Inc. 5.75% 01/05/2028	134.703	0,07
USD	245.000	DirectTV Holdings LLC 5.88% 15/08/2027	255.925	0,14	USD	633.000	HUB International Limited 7.00% 01/05/2026	654.840	0,34
USD	938.000	DISH DBS Corp. 5.13% 01/06/2029	921.780	0,49	USD	333.000	IAA Inc. 5.50% 15/06/2027	348.193	0,18
USD	332.000	DISH DBS Corp. 7.75% 01/07/2026	375.289	0,20	USD	391.000	iHeartCommunications 4.75% 15/01/2028	402.970	0,21
USD	377.000	DT Midstream Inc. 4.13% 15/06/2029	383.243	0,20	USD	212.000	iHeartCommunications Inc. 5.25% 15/08/2027	220.943	0,12
USD	355.000	DT Midstream Inc. 4.38% 15/06/2031	366.630	0,19	USD	689.757	iHeartCommunications Inc. 8.38% 01/05/2027	737.393	0,39
USD	579.000	Element Solutions Inc. 3.88% 01/09/2028	588.626	0,31	USD	446.000	Innophos Holdings Inc. 9.38% 15/02/2028	481.680	0,25
USD	236.000	Endeavor Energy Resources LP 5.75% 30/01/2028	249.052	0,13	USD	221.000	Interface Inc. 5.50% 01/12/2028	233.387	0,12
USD	166.000	Energizer Holdings Inc. 4.75% 15/06/2028	168.542	0,09	USD	603.000	lqvia Inc. 5.00% 15/05/2027	627.146	0,33
USD	304.000	EQM Midstream Partner LP 4.50% 15/01/2029	315.784	0,17	USD	911.000	IRB Holding Corp. 6.75% 15/02/2026	937.988	0,50
USD	517.000	EQM Midstream Partner LP 4.75% 15/01/2031	538.337	0,28	USD	344.000	IRB Holding Corp. 7.00% 15/06/2025	365.697	0,19
USD	270.000	EQM Midstream Partner LP 6.00% 01/07/2025	296.505	0,16	USD	237.000	Iron Mountain Inc. 5.00% 15/07/2028	247.518	0,13
USD	143.000	EQM Midstream Partner LP 6.50% 01/07/2027	161.018	0,08	USD	299.000	Iron Mountain Inc. 5.25% 15/03/2028	313.177	0,17
USD	178.000	EQT Corp. 3.63% 15/05/2031	185.325	0,10	USD	255.000	ITT Holdings LLC 6.50% 01/08/2029	258.525	0,14
USD	353.000	Flex Acquisition Company Inc. 7.88% 15/07/2026	370.653	0,20	USD	122.000	Jaguar Holding Company II 4.63% 15/06/2025	127.672	0,07
USD	202.000	Gartner Inc. 3.63% 15/06/2029	205.162	0,11	USD	189.000	Jaguar Holding Company II 5.00% 15/06/2028	203.293	0,11
USD	373.000	Gartner Inc. 3.75% 01/10/2030	384.823	0,20	USD	258.000	JBS USA Lux SA 3.75% 01/12/2031	268.359	0,14
USD	345.000	Gartner Inc. 4.50% 01/07/2028	362.485	0,19	USD	542.000	Kaiser Aluminum Corp. 4.50% 01/06/2031	556.222	0,29
USD	783.000	Gates Global LLC 6.25% 15/01/2026	812.036	0,43	USD	1.019.000	Kar Auction Services Inc. 5.13% 01/06/2025	1.031.100	0,54
USD	379.000	H&E Equipment Se 3.88% 15/12/2028	378.126	0,20	USD	200.000	Ladder Capital Finance Holdings LLLP 4.25% 01/02/2027	198.703	0,10

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

### Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>				<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>					
USD	786.000	Ladder Capital Finance Holdings LLLP 4.75% 15/06/2029	783.543	0,41	USD	651.000	NCR Corp. 5.00% 01/10/2028	666.418	0,35
USD	652.000	Ladder Capital Finance Holdings LLLP 5.25% 01/10/2025	660.150	0,35	USD	273.000	Nesco Holdings II Inc. 5.50% 15/04/2029	283.497	0,15
USD	133.000	Leeward Renewable Energy Operations LLC 4.25% 01/07/2029	135.019	0,07	USD	171.000	Netflix Inc. 4.88% 15/06/2030	201.673	0,11
USD	174.000	Live Nation Entertainment Inc. 3.75% 15/01/2028	173.819	0,09	USD	259.000	Netflix Inc. 5.38% 15/11/2029	313.754	0,17
USD	481.000	Live Nation Entertainment Inc. 4.75% 15/10/2027	489.476	0,26	USD	452.000	NextEra Energy Operating Partners LP 4.50% 15/09/2027	486.465	0,25
USD	474.000	Live Nation Entertainment Inc. 6.50% 15/05/2027	522.289	0,28	USD	461.000	NFP Corp. 4.88% 15/08/2028	467.685	0,25
USD	651.000	LogMeIn Inc. 5.50% 01/09/2027	662.051	0,35	USD	966.000	NFP Corp. 6.88% 15/08/2028	986.939	0,51
USD	266.000	Lumen Technologies Inc. 5.38% 15/06/2029	270.323	0,14	USD	268.000	Nielsen Finance LLC 4.50% 15/07/2029	261.843	0,14
USD	214.000	Macy's Retail Holdings 5.88% 01/04/2029	232.591	0,12	USD	336.000	Nielsen Finance LLC 4.75% 15/07/2031	327.281	0,17
USD	317.000	Madison IAQ LLC 4.13% 30/06/2028	317.198	0,17	USD	261.000	Nielsen Finance LLC 5.63% 01/10/2028	271.440	0,14
USD	557.000	Madison IAQ LLC 5.88% 30/06/2029	564.303	0,29	USD	188.000	Northwest Fiber LLC 6.00% 15/02/2028	186.708	0,10
USD	404.000	Matador Resources Company 5.88% 15/09/2026	418.645	0,22	USD	268.000	Novelis Corp. 3.25% 15/11/2026	271.298	0,14
USD	463.000	Match Group Holdings II LLC 4.63% 01/06/2028	484.718	0,26	USD	323.000	Novelis Corp. 3.88% 15/08/2031	320.069	0,17
USD	173.000	Mattel Inc. 5.88% 15/12/2027	187.489	0,10	USD	688.000	Novelis Corp. 4.75% 30/01/2030	724.204	0,38
USD	457.000	Mauser Packaging Solutions Holding Company 5.50% 15/04/2024	461.194	0,24	USD	260.000	NRG Energy Inc. 3.38% 15/02/2029	256.917	0,14
USD	600.000	Meritage Homes Corp. 3.88% 15/04/2029	630.375	0,34	USD	625.000	NRG Energy Inc. 3.63% 15/02/2031	615.078	0,31
USD	485.000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP 4.63% 15/06/2025	524.118	0,28	USD	379.000	NRG Energy Inc. 3.88% 15/02/2032	374.973	0,20
USD	260.000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP Mgp Finance Co-Issuer Inc. 5.75% 01/02/2027	299.163	0,16	USD	85.000	Occidental Petroleum Corp. 6.20% 15/03/2040	100.317	0,05
USD	89.000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP MGP Finance Co-Issuer Inc. 3.88% 15/02/2029	94.809	0,05	USD	491.000	Occidental Petroleum Corp. 6.45% 15/09/2036	617.433	0,33
USD	214.000	Midwest Gaming Borrower LLC 4.88% 01/05/2029	218.280	0,12	USD	122.000	Occidental Petroleum Corp. 6.60% 15/03/2046	153.762	0,08
USD	899.469	Mileage Plus Holdings LLC 6.50% 20/06/2027	979.859	0,52	USD	342.000	Olympus Water USA 4.25% 01/10/2028	338.016	0,18
USD	175.000	NCR Corp 5.75% 01/09/2027	185.048	0,10	USD	144.000	Olympus Water USA 6.25% 01/10/2029	142.967	0,08
USD	120.000	NCR Corp 6.13% 01/09/2029	130.255	0,07	USD	343.000	Organon & Company 4.13% 30/04/2028	350.394	0,18
					USD	533.000	Organon & Company 5.13% 30/04/2031	559.643	0,30
					USD	558.000	Ortho-Clinical Diagnostics Inc. 7.25% 01/02/2028	599.251	0,32
					USD	196.000	Outfront Media Capital LLC 4.25% 15/01/2029	194.631	0,10
					USD	211.000	Outfront Media Capital LLC 4.63% 15/03/2030	211.712	0,11
					USD	78.000	Outfront Media Capital LLC 5.00% 15/08/2027	80.080	0,04

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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>				<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>					
USD	257.000	Par Pharmaceutical Inc. 7.50% 01/04/2027	261.330	0,14	USD	137.000	Sabre GLBL Inc. 9.25% 15/04/2025	158.514	0,08
USD	334.000	Park Intermediate Holdings LLC 4.88% 15/05/2029	342.768	0,18	USD	458.000	Scientific Games International Inc. 5.00% 15/10/2025	471.195	0,25
USD	395.000	Park Intermediate Holdings LLC 5.88% 01/10/2028	418.206	0,22	USD	164.000	Scientific Games International Inc. 7.00% 15/05/2028	177.223	0,09
USD	436.000	PetSmart Inc. 4.75% 15/02/2028	449.625	0,24	USD	466.000	Scientific Games International Inc. 7.25% 15/11/2029	524.198	0,28
USD	105.000	PetSmart Inc. 7.75% 15/02/2029	114.385	0,06	USD	217.000	Scientific Games International Inc. 8.25% 15/03/2026	231.297	0,12
USD	907.000	Pilgrim's Pride Corp. 3.50% 01/03/2032	922.963	0,49	USD	359.000	Scientific Games International Inc. 8.63% 01/07/2025	389.105	0,21
USD	1.098.000	Pilgrim's Pride Corp. 4.25% 15/04/2031	1.175.348	0,62	USD	177.000	Scotts Miracle-Gro Company 4.00% 01/04/2031	176.778	0,09
USD	1.012.000	Plantronics Inc. 4.75% 01/03/2029	949.706	0,50	USD	514.000	Scotts Miracle-Gro Company 4.38% 01/02/2032	519.140	0,28
USD	672.000	Post Holdings Inc. 4.63% 15/04/2030	677.566	0,36	USD	75.000	Scripps Escrow II Inc. 3.88% 15/01/2029	75.292	0,04
USD	200.000	Post Holdings Inc. 5.63% 15/01/2028	210.303	0,11	USD	676.000	Select Medical Corp. 6.25% 15/08/2026	712.351	0,37
USD	821.000	Post Holdings Inc. 5.75% 01/03/2027	854.743	0,45	USD	130.000	Service Properties Trust 5.50% 15/12/2027	138.718	0,07
USD	200.000	PRA Health Sciences Inc. 2.88% 15/07/2026	202.741	0,11	USD	173.000	Shea Homes LP Shea Homes Funding Corp. 4.75% 15/02/2028	177.819	0,09
USD	279.000	Prestige Brands Inc. 5.13% 15/01/2028	293.648	0,15	USD	362.000	Shift4 Payments LLC 4.63% 01/11/2026	378.290	0,20
USD	740.000	Provident Funding Associates LP 6.38% 15/06/2025	754.800	0,40	USD	235.000	Simmons Food Inc. 4.63% 01/03/2029	237.926	0,13
USD	326.000	Radiate Holco LLC 4.50% 15/09/2026	336.496	0,18	USD	196.000	Sirius Xm Radio Inc. 4.13% 01/07/2030	197.651	0,10
USD	760.000	Radiate Holco LLC 6.50% 15/09/2028	776.625	0,41	USD	384.000	Sirius XM Radio Inc. 3.13% 01/09/2026	389.760	0,21
USD	358.000	Resideo Funding Inc. 4.00% 01/09/2029	350.060	0,18	USD	204.000	Sirius XM Radio Inc. 4.00% 15/07/2028	208.335	0,11
USD	181.000	RHP Hotel Properties LP 4.50% 15/02/2029	181.624	0,10	USD	400.000	Six Flags Entertainment Corp. 4.88% 31/07/2024	404.446	0,21
USD	230.000	RLJ Lodging Trust LP 3.75% 01/07/2026	232.588	0,12	USD	268.000	Six Flags Theme Parks Inc. 7.00% 01/07/2025	285.588	0,15
USD	219.000	RLJ Lodging Trust LP 4.00% 15/09/2029	219.479	0,12	USD	206.000	Southwestern Energy Company 5.38% 01/02/2029	221.125	0,12
USD	483.000	Rocket Mortgage LLC 3.63% 01/03/2029	489.038	0,25	USD	238.000	SRS Distribution Inc. 4.63% 01/07/2028	243.254	0,13
USD	208.000	Rocket Mortgage LLC 3.88% 01/03/2031	209.950	0,11	USD	463.000	SRS Distribution Inc. 6.13% 01/07/2029	477.179	0,25
USD	1.011.000	Rocket Mortgage LLC 4.00% 15/10/2033	1.004.681	0,53	USD	449.000	Staples Inc. 7.50% 15/04/2026	455.949	0,24
USD	523.000	RP Escrow Issuer LLC 5.25% 15/12/2025	539.070	0,28	USD	235.000	Stevens Holding Company Inc. 6.13% 01/10/2026	253.947	0,13
USD	301.000	Sabre GLBL Inc. 7.38% 01/09/2025	321.182	0,17	USD	442.000	Sunoco LP Sunoco Finance Corp. 5.88% 15/03/2028	467.716	0,25

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

### Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>				<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>					
USD	217.000	Surgery Center Holdings Inc. 6.75% 01/07/2025	221.204	0,12	USD	255.000	Uber Technologies Inc. 6.25% 15/01/2028	274.124	0,14
USD	127.000	Switch Limited 3.75% 15/09/2028	129.263	0,07	USD	174.000	Unifrax Escrow Issuer Corp. 5.25% 30/09/2028	176.284	0,09
USD	267.000	Switch Limited 4.13% 15/06/2029	275.032	0,15	USD	98.000	Unifrax Escrow Issuer Corp. 7.50% 30/09/2029	100.366	0,05
USD	153.000	Syneos Health Inc. 3.63% 15/01/2029	152.522	0,08	USD	309.000	United Airlines Inc. 4.38% 15/04/2026	317.987	0,17
USD	308.000	Targa Resources Partners LP 4.00% 15/01/2032	318.261	0,17	USD	422.000	Univision Communications Inc. 4.50% 01/05/2029	429.679	0,23
USD	324.000	Targa Resources Partners LP 4.88% 01/02/2031	350.125	0,18	USD	498.000	US Foods Inc. 4.75% 15/02/2029	511.421	0,27
USD	83.000	Targa Resources Partners LP 5.00% 15/01/2028	87.507	0,05	USD	136.000	USA Compression Partners LP 6.88% 01/04/2026	141.018	0,07
USD	657.000	Targa Resources Partners LP 5.50% 01/03/2030	718.748	0,39	USD	393.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC 3.88% 15/08/2029	405.782	0,21
USD	510.000	Taylor Morrison 5.88% 15/04/2023	535.500	0,28	USD	374.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC 4.13% 15/08/2031	390.947	0,21
USD	88.000	Teleflex Inc. 4.25% 01/06/2028	91.246	0,05	USD	452.000	Verscend Escrow Corp. 9.75% 15/08/2026	476.578	0,25
USD	136.000	Tempo Acquisition LLC 5.75% 01/06/2025	142.978	0,08	USD	509.000	Vici Properties LP 3.75% 15/02/2027	528.151	0,28
USD	170.000	Tempur Sealy International Inc. 3.88% 15/10/2031	170.482	0,09	USD	449.000	Vistra Operations Company LLC 5.63% 15/02/2027	465.023	0,25
USD	115.000	Tenet Healthcare Corp. 4.63% 15/06/2028	119.427	0,06	USD	737.000	Waste Pro USA Inc. 5.50% 15/02/2026	747.249	0,40
USD	365.000	Tenet Healthcare Corp. 4.88% 01/01/2026	378.202	0,20	USD	344.000	Wesco Distribution Inc. 7.13% 15/06/2025	368.166	0,19
USD	505.000	Tenet Healthcare Corp. 5.13% 01/11/2027	528.648	0,28	USD	975.000	Wesco Distribution Inc. 7.25% 15/06/2028	1.080.421	0,57
USD	682.000	Tenet Healthcare Corp. 6.13% 01/10/2028	716.720	0,37	USD	376.000	White Cap Buyer LLC 6.88% 15/10/2028	398.116	0,21
USD	595.000	Tenet Healthcare Corp. 6.25% 01/02/2027	618.970	0,33	USD	770.000	WR Grace Holdings LLC 5.63% 15/08/2029	794.140	0,43
USD	384.000	Tenet Healthcare Corp. 7.50% 01/04/2025	408.480	0,22	USD	283.000	Wyndham Hotels & Resorts Inc. 4.38% 15/08/2028	295.069	0,16
USD	748.000	Tenneco Inc. 7.88% 15/01/2029	836.307	0,44	USD	416.000	Wynn Las Vegas LLC 5.50% 01/03/2025	425.188	0,22
USD	271.000	Terraform Power Operating LLC 4.75% 15/01/2030	284.042	0,15	USD	581.000	Zayo Group Holdings Inc. 4.00% 01/03/2027	578.888	0,31
USD	192.000	Terraform Power Operating LLC 5.00% 31/01/2028	207.155	0,11	USD	342.000	Zayo Group Holdings Inc. 6.13% 01/03/2028	346.962	0,18
USD	499.000	TransDigm Inc. 4.88% 01/05/2029	501.405	0,26	USD	690.000	ZoomInfo Technologies LLC 3.88% 01/02/2029	687.412	0,36
USD	1.263.000	TransDigm Inc. 6.25% 15/03/2026	1.321.066	0,70			<b>Total de Estados Unidos</b>	<b>118.792.945</b>	<b>62,72</b>
USD	569.000	TransDigm Inc. 8.00% 15/12/2025	607.763	0,32			<b>Total de bonos</b>	<b>138.433.451</b>	<b>73,08</b>
USD	619.000	TransMontaigne Partners LP 6.13% 15/02/2026	635.524	0,34			<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente</b>	<b>138.433.451</b>	<b>73,08</b>
USD	1.387.000	Uber Technologies Inc. 4.50% 15/08/2029	1.397.402	0,74					

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			
<b>Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario</b>				<b>Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario (continuación)</b>						
<b>Bonos</b>				<b>Bonos (continuación)</b>						
<b>CANADÁ</b>				<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>						
USD	371.000	Ritchie Bros Auctioneers Inc. 5.38% 15/01/2025	380.319	0,20	USD	373.000	TK Elevator US Newco Inc. 5.25% 15/07/2027	391.618	0,22	
<b>Total de Canadá</b>			<b>380.319</b>	<b>0,20</b>	USD	396.000	WR Grace Holdings LLC 4.88% 15/06/2027	408.127	0,21	
<b>FRANCIA</b>				<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>						
USD	484.000	Altice France SA 5.50% 15/10/2029	480.022	0,25	USD	100.000	Wynn Resorts Finance LLC 5.13% 01/10/2029	101.188	0,05	
<b>Total de Francia</b>			<b>480.022</b>	<b>0,25</b>	<b>Total de Estados Unidos</b>			<b>4.240.939</b>	<b>2,25</b>	
<b>ALEMANIA</b>				<b>Total de bonos</b>				<b>6.663.694</b>	<b>3,51</b>	
USD	363.000	TK Elevator Holdco GmbH 7.63% 15/07/2028	388.410	0,20	<b>Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario</b>				<b>6.663.694</b>	<b>3,51</b>
<b>Total de Alemania</b>			<b>388.410</b>	<b>0,20</b>	<b>Valor total de las inversiones</b>				<b>186.714.332</b>	<b>98,50</b>
<b>LUXEMBURGO</b>				<b>(Coste total: 179.432.960 USD)</b>						
USD	372.000	Axalta Coating Systems LLC 4.75% 15/06/2027	387.345	0,20						
<b>Total de Luxemburgo</b>			<b>387.345</b>	<b>0,20</b>						
<b>REINO UNIDO</b>										
USD	788.000	Vmed O2 UK Financing I plc 4.25% 31/01/2031	786.659	0,41						
<b>Total del Reino Unido</b>			<b>786.659</b>	<b>0,41</b>						
<b>ESTADOS UNIDOS</b>										
USD	141.000	Albertsons Companies Inc. 7.50% 15/03/2026	152.608	0,08						
USD	188.000	APX Group Inc. 5.75% 15/07/2029	185.710	0,10						
USD	358.000	Aramark Services Inc. 5.00% 01/02/2028	368.625	0,19						
USD	729.000	Ascend Learning LLC 6.88% 01/08/2025	744.392	0,39						
USD	279.000	Calpine Corp. 5.25% 01/06/2026	287.190	0,15						
USD	236.000	HealthEquity Inc. 4.50% 01/10/2029	241.122	0,13						
USD	372.000	Holly Energy Partners Corp. 5.00% 01/02/2028	377.673	0,20						
USD	342.000	Illuminate Buyer LLC 9.00% 01/07/2028	377.033	0,20						
USD	220.000	Ingevity Corp. 3.88% 01/11/2028	220.000	0,12						
USD	219.000	Iris Holdings Inc. 8.75% 15/02/2026	223.377	0,12						
USD	153.000	NextEra Energy Operating Partners LP 4.25% 15/07/2024	162.276	0,09						

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

### Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2021

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Bonos</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>BAHAMAS</b>				<b>ISLAS CAIMÁN (continuación)</b>					
USD	200.000	Competition Team Technologies Limited 3.75% 12/03/2024	213.299	0,33	USD	250.000	Sun Hung Kai Properties Capital Market Limited 2.75% 13/05/2030	254.886	0,39
<b>Total de Bahamas</b>			<b>213.299</b>	<b>0,33</b>	USD	270.000	Sun Hung Kai Properties Capital Market Limited 3.75% 25/02/2029	294.298	0,45
<b>BERMUDAS</b>				USD	400.000	Tencent Holdings Limited 2.88% 22/04/2031	408.970	0,63	
USD	200.000	China Oil & Gas Group Limited 5.50% 25/01/2023	204.955	0,32	USD	300.000	Tencent Holdings Limited 3.98% 11/04/2029	329.359	0,51
<b>Total de Bermudas</b>			<b>204.955</b>	<b>0,32</b>	USD	467.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp. 1.63% 24/09/2025	464.832	0,72
<b>ISLAS CAIMÁN</b>				<b>Total de Islas Caimán</b>					
USD	250.000	AAC Technologies Holdings Inc. 3.00% 27/11/2024	256.956	0,40				<b>10.836.255</b>	<b>16,74</b>
USD	250.000	Alibaba Group Holding Limited 4.50% 28/11/2034	287.765	0,44	<b>HONG KONG</b>				
USD	500.000	China Mengniu Dairy Company 1.88% 17/06/2025	500.897	0,77	USD	400.000	Bank of East Asia Limited FRN 29/05/2030	419.836	0,65
USD	200.000	CIFI Holdings (Group) 4.38% 12/04/2027	186.235	0,29	USD	200.000	Glp China Holdings 2.95% 29/03/2026	200.959	0,31
USD	600.000	CIFI Holdings Group Company Limited 6.00% 16/07/2025	600.240	0,93	USD	500.000	Icbcil Finance Company 3.13% 15/11/2022	511.314	0,79
USD	600.000	CK Hutchison International 17 II Limited 3.25% 29/09/2027	650.091	1,01	USD	950.000	Lenovo Group Limited 5.88% 24/04/2025	1.071.375	1,66
USD	200.000	Country Garden Holdings Company Limited 3.13% 22/10/2025	190.125	0,29	USD	700.000	Xiaomi Best Time International Limited 2.88% 14/07/2031	693.685	1,08
USD	200.000	Country Garden Holdings Company Limited 5.40% 27/05/2025	204.254	0,32	<b>Total de Hong Kong</b>			<b>2.897.169</b>	<b>4,49</b>
USD	600.000	Country Garden Holdings Company Limited 7.25% 08/04/2026	634.223	0,98	<b>INDIA</b>				
USD	500.000	ENN Energy Holdings Limited 2.63% 17/09/2030	495.992	0,76	USD	600.000	Adani Electricity Mumbai Limited 3.95% 12/02/2030	601.077	0,93
USD	600.000	Goodman HK Finance 3.00% 22/07/2030	611.039	0,94	USD	280.000	Adani Green Energy Limited 4.38% 08/09/2024	280.757	0,43
USD	500.000	HPHT Finance 19 Limited 2.88% 05/11/2024	525.250	0,81	USD	300.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 3.10% 02/02/2031	286.400	0,44
USD	500.000	JD.Com Inc. 3.38% 14/01/2030	525.006	0,81	USD	200.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.00% 30/07/2027	208.727	0,32
USD	1.000.000	Logan Group Company Limited 4.70% 06/07/2026	945.075	1,46	USD	400.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029	418.660	0,65
USD	600.000	Longfor Properties Company 4.50% 16/01/2028	644.677	1,00	USD	800.000	Adani Transmission Limited 4.00% 03/08/2026	845.109	1,31
USD	800.000	Meituan 3.05% 28/10/2030	741.601	1,15	USD	650.000	Bharti Airtel Limited 4.38% 10/06/2025	699.634	1,08
USD	500.000	Melco Resorts Finance Limited 4.88% 06/06/2025	503.159	0,78	USD	226.000	GMR Hyderabad International Airport Limited 4.75% 02/02/2026	226.190	0,35
USD	600.000	Powerlong Real Estate Holdings Limited 6.25% 10/08/2024	581.325	0,90					

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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>SINGAPUR (continuación)</b>				<b>ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS) (continuación)</b>					
USD	500.000	United Overseas Bank Limited FRN 08/03/2027	503.987	0,78	USD	500.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Limited 2.95% 12/11/2029	523.732	0,81
		<b>Total de Singapur</b>	<b>4.038.010</b>	<b>6,23</b>	USD	750.000	State Grid Overseas Investment 2016 Limited 1.63% 05/08/2030	713.903	1,10
<b>TAILANDIA</b>				<b>ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS) (continuación)</b>					
USD	800.000	Bangkok Bank plc FRN 25/09/2034	814.373	1,26	USD	500.000	Studio City Finance Limited 5.00% 15/01/2029	464.685	0,72
USD	200.000	GC Treasury Centre Company Limited 2.98% 18/03/2031	203.127	0,31	USD	700.000	Studio City Finance Limited 6.00% 15/07/2025	695.497	1,07
USD	400.000	Kasikornbank plc FRN 02/10/2031	403.633	0,62	USD	850.000	TSMC Global Limited 0.75% 28/09/2025	830.885	1,29
USD	500.000	Ptttep Treasury Center Company Limited 2.99% 15/01/2030	520.632	0,80	USD	400.000	Yongda Investment Limited 2.25% 16/06/2025	402.208	0,62
		<b>Total de Tailandia</b>	<b>1.941.765</b>	<b>2,99</b>			<b>Total de Islas Vírgenes (Británicas)</b>	<b>10.572.574</b>	<b>16,37</b>
<b>REINO UNIDO</b>				<b>Total de bonos</b>					
USD	1.000.000	HSBC Holdings plc Perp FRN	1.042.689	1,62			<b>52.245.848</b>	<b>80,78</b>	
USD	600.000	Standard Chartered plc Perp FRN	658.016	1,02	<b>Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda</b>				
USD	400.000	Vedanta Resources plc 6.13% 09/08/2024	358.245	0,55	<b>CHINA</b>				
		<b>Total del Reino Unido</b>	<b>2.058.950</b>	<b>3,19</b>	USD	606.000	China (Govt of) 1.95% 03/12/2024	632.175	0,98
<b>ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)</b>				<b>Total de China</b>					
USD	500.000	CMHI Finance Company Perp FRN	515.398	0,80			<b>632.175</b>	<b>0,98</b>	
USD	500.000	CNPC Global Capital Limited 1.35% 23/06/2025	496.249	0,77	<b>INDIA</b>				
USD	650.000	Contemporary Ruiding Development Limited 2.63% 17/09/2030	653.399	1,01	USD	400.000	Export-Import Bank of India 3.25% 15/01/2030	406.245	0,63
USD	800.000	Elect Global Investments Limited Perp FRN	816.256	1,27			<b>Total de India</b>	<b>406.245</b>	<b>0,63</b>
USD	750.000	FPC Resources Limited 4.38% 11/09/2027	801.852	1,24	<b>INDONESIA</b>				
USD	511.000	HKT Capital No 5 Limited 3.25% 30/09/2029	541.864	0,84	USD	800.000	Indonesia (Govt of) 3.40% 18/09/2029	863.062	1,33
USD	500.000	Hongkong Electric Finance Limited 1.88% 27/08/2030	482.547	0,75	USD	1.000.000	Indonesia (Govt of) 4.75% 11/02/2029	1.168.020	1,81
USD	1.439.000	Jgsh Philippines Limited 4.13% 09/07/2030	1.540.224	2,39	USD	200.000	Indonesia (Govt of) 6.63% 17/02/2037	273.023	0,42
USD	600.000	Nan Fung Treasury Limited 5.00% 05/09/2028	661.555	1,02	USD	300.000	Indonesia (Govt of) 7.75% 17/01/2038	447.293	0,69
USD	400.000	Sinopec Group Overseas Development 2017 Limited 3.25% 13/09/2027	432.320	0,67	USD	200.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 2.30% 23/06/2025	207.732	0,32
							<b>Total de Indonesia</b>	<b>2.959.130</b>	<b>4,57</b>
				<b>PAKISTÁN</b>					
				USD	350.000	Pakistan (Govt of) 6.00% 08/04/2026	349.049	0,54	

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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente</b>					
<b>Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)</b>				<b>Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda</b>					
<b>PAKISTÁN (continuación)</b>				<b>CHINA</b>					
USD	350.000	Pakistan (Govt of) 6.88% 05/12/2027	352.971	0,55	CNY	6.000.000	China (Govt of) 2.36% 02/07/2023	928.290	1,44
USD	200.000	Pakistan (Govt of) 8.25% 30/09/2025	217.605	0,34	CNY	10.000.000	China (Govt of) 2.85% 04/06/2027	1.555.439	2,39
		<b>Total de Pakistán</b>	<b>919.625</b>	<b>1,43</b>	CNY	7.000.000	China (Govt of) 3.12% 05/12/2026	1.104.981	1,71
				<b>Total de China</b>				<b>3.588.710</b>	<b>5,54</b>
				<b>Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda</b>				<b>3.588.710</b>	<b>5,54</b>
<b>FILIPINAS</b>				<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente</b>				<b>3.588.710</b>	<b>5,54</b>
USD	1.000.000	Philippine (Govt of) 3.00% 01/02/2028	1.069.904	1,65					
USD	900.000	Philippine (Govt of) 3.75% 14/01/2029	1.006.682	1,56	<b>Valor total de las inversiones</b>				
		<b>Total de Filipinas</b>	<b>2.076.586</b>	<b>3,21</b>	<b>63.554.536</b>				
				<b>(Coste total: 62.908.203 USD)</b>				<b>98,26</b>	
<b>ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)</b>									
USD	700.000	Talent Yield International Limited 3.13% 06/05/2031	726.217	1,12					
		<b>Total de Islas Vírgenes (Británicas)</b>	<b>726.217</b>	<b>1,12</b>					
<b>Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda</b>				<b>7.719.978</b>	<b>11,94</b>				
<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>59.965.826</b>	<b>92,72</b>				

## Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return

### Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2021

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios (continuación)</b>					
<b>Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda</b>				<b>Fondos (continuación)</b>					
<b>ALEMANIA</b>				<b>LUXEMBURGO (continuación)</b>					
EUR	3.000.000	Germany (Govt of) 0.00% 23/03/2022	3.010.476	9,01	117.395	Threadneedle (Lux) - Global Focus XU*	2.627.446	7,87	
					88.703	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies 4E*	1.297.411	3,88	
		<b>Total de Alemania</b>	<b>3.010.476</b>	<b>9,01</b>		<b>Total de Luxemburgo</b>	<b>18.092.098</b>	<b>54,18</b>	
<b>Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda</b>					<b>Total de fondos</b>	<b>19.840.037</b>	<b>59,41</b>		
					<b>Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>	<b>19.840.037</b>	<b>59,41</b>		
<b>Instrumentos estructurados - Materias primas</b>				<b>Otros organismos de inversión colectiva</b>					
<b>IRLANDA</b>				<b>Fondos</b>					
	3.851	Invesco Physical Gold ETC 0.00%	566.195	1,70	<b>REINO UNIDO</b>				
		<b>Total de Irlanda</b>	<b>566.195</b>	<b>1,70</b>	EUR	67.108	Threadneedle Investment Funds ICVC - American Fund**	490.490	1,47
<b>Total de instrumentos estructurados - Materias primas</b>					GBP	253.966	Threadneedle Investment Funds ICVC - American Fund**	634.670	1,90
					GBP	554.213	Threadneedle Investment Funds ICVC - Asia Fund**	1.489.969	4,46
<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>					GBP	154.866	Threadneedle Investment Funds ICVC - European Fund**	347.720	1,04
					GBP	969.480	Threadneedle Investment Funds ICVC - Japan Fund**	2.514.125	7,53
					EUR	339.911	Threadneedle Specialist Investment Funds ICVC - Emerging Market Local Fund**	888.153	2,66
<b>Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>					GBP	1.548.159	Threadneedle Specialist Investment Funds ICVC - Sterling Short-Dated Corp.Bond Fund**	2.097.817	6,28
<b>Fondos</b>						<b>Total del Reino Unido</b>	<b>8.462.944</b>	<b>25,34</b>	
<b>IRLANDA</b>						<b>Total de fondos</b>	<b>8.462.944</b>	<b>25,34</b>	
	17.734	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	1.747.939	5,23		<b>Total de otros organismos de inversión colectiva</b>	<b>8.462.944</b>	<b>25,34</b>	
		<b>Total de Irlanda</b>	<b>1.747.939</b>	<b>5,23</b>		<b>Valor total de las inversiones</b>	<b>31.879.652</b>	<b>95,46</b>	
<b>LUXEMBURGO</b>						<b>(Coste total: 27.678.663 EUR)</b>			
	122.831	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities XU*	1.972.995	5,91					
	236.347	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond 4E*	2.614.853	7,83					
	74.915	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds XU*	747.607	2,24					
	305.372	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities XE*	3.297.984	9,88					
	194.598	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond 4E*	2.260.957	6,77					
	30.817	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond XE*	3.272.845	9,80					

\* Consulte la nota 18.

\*\* Fondo de parte vinculada.

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return

### Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2021

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>			
<b>Renta variable</b>				<b>Renta variable (continuación)</b>			
<b>ISLAS CAIMÁN</b>				<b>JAPÓN</b>			
1.094	Sea Limited	348.691	0,66	900	Keyence Corp.	540.444	1,02
	<b>Total de Islas Caimán</b>	<b>348.691</b>	<b>0,66</b>	4.900	Rohm Company Limited	467.273	0,89
<b>DINAMARCA</b>				11.500	Sekisui Chemical Company Limited	198.615	0,38
4.947	Novo-Nordisk A/S	479.117	0,91	3.300	Sony Corp.	368.375	0,70
2.459	Orsted AS	325.307	0,62	7.800	Yaskawa Electric Corp.	377.504	0,72
12.286	Tryg A/S	279.380	0,53		<b>Total de Japón</b>	<b>1.952.211</b>	<b>3,71</b>
	<b>Total de Dinamarca</b>	<b>1.083.804</b>	<b>2,06</b>	<b>PAÍSES BAJOS</b>			
<b>FINLANDIA</b>				1.560	Airbus SE	208.096	0,40
7.125	Upm-Kymmene Oyj	253.588	0,48		<b>Total de Países Bajos</b>	<b>208.096</b>	<b>0,40</b>
	<b>Total de Finlandia</b>	<b>253.588</b>	<b>0,48</b>	<b>NORUEGA</b>			
<b>FRANCIA</b>				10.746	Equinor ASA	274.089	0,52
2.349	Essilor International SA	450.553	0,86		<b>Total de Noruega</b>	<b>274.089</b>	<b>0,52</b>
3.510	Schneider Electric SE	585.373	1,11	<b>REPÚBLICA DE COREA (SUR)</b>			
	<b>Total de Francia</b>	<b>1.035.926</b>	<b>1,97</b>	13.072	Samsung Electronics Company Limited	818.100	1,55
<b>ALEMANIA</b>				449	Samsung Sdi Company Limited	272.281	0,52
1.207	Adidas AG	380.208	0,72		<b>Total de República de Corea (Sur)</b>	<b>1.090.381</b>	<b>2,07</b>
	<b>Total de Alemania</b>	<b>380.208</b>	<b>0,72</b>	<b>SUIZA</b>			
<b>HONG KONG</b>				4.102	Nestle SA - Reg	495.573	0,94
42.200	AIA Group Limited	487.612	0,93	1.143	Roche Holding AG	418.984	0,80
	<b>Total de Hong Kong</b>	<b>487.612</b>	<b>0,93</b>	3.360	TE Connectivity Limited	461.059	0,88
<b>INDIA</b>					<b>Total de Suiza</b>	<b>1.375.616</b>	<b>2,62</b>
6.109	HDFC Bank Limited - ADR	446.507	0,85	<b>TAIWÁN</b>			
	<b>Total de India</b>	<b>446.507</b>	<b>0,85</b>	25.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	520.449	0,99
<b>INDONESIA</b>					<b>Total de Taiwán</b>	<b>520.449</b>	<b>0,99</b>
1.686.750	Bank Rakyat Indonesia	453.735	0,86	<b>REINO UNIDO</b>			
	<b>Total de Indonesia</b>	<b>453.735</b>	<b>0,86</b>	9.393	Diageo plc	456.702	0,87
<b>IRLANDA</b>				13.734	SSE plc	290.922	0,55
9.159	CRH plc	430.537	0,82		<b>Total del Reino Unido</b>	<b>747.624</b>	<b>1,42</b>
5.362	Medtronic Inc.	672.127	1,28	<b>ESTADOS UNIDOS</b>			
2.153	Trane Technologies plc	371.715	0,71	2.512	Abbott Laboratories	296.743	0,56
	<b>Total de Irlanda</b>	<b>1.474.379</b>	<b>2,81</b>	4.500	Activision Blizzard Inc.	348.255	0,66

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return

### Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo	
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				
<b>Renta variable (continuación)</b>				<b>Instrumentos estructurados - Materias primas</b>				
<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>				<b>IRLANDA</b>				
1.369	Adobe Systems Inc.	788.161	1,50	8.169	Invesco Physical Gold ETC 0.00%	1.391.957	2,64	
701	Alphabet Inc. - A	1.874.138	3,56	<b>Total de Irlanda</b>				
491	Amazon.com Inc.	1.612.954	3,05	<b>1.391.957 2,64</b>				
1.258	American Tower Corp.	333.886	0,63	<b>Total de instrumentos estructurados - Materias primas</b>				
1.759	Autodesk Inc.	501.614	0,95	<b>1.391.957 2,64</b>				
5.662	Centene Corp.	352.799	0,67	<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				
10.313	Comcast Corp.	576.806	1,10	<b>34.577.626 65,66</b>				
922	Cooper Companies Inc.	381.072	0,72	<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente</b>				
1.150	Deere & Company	385.331	0,73	<b>Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda</b>				
1.732	Ecolab Inc.	361.330	0,69	<b>ESTADOS UNIDOS</b>				
1.782	Edwards Lifesciences Corp.	201.740	0,38	USD	2.600.000	United States Treasury Bill 0.00% 05/10/2021	2.599.996	4,94
2.809	Electronic Arts Inc.	399.580	0,76	USD	3.500.000	United States Treasury Bill 0.00% 17/03/2022	3.499.300	6,64
423	Equinix Inc.	334.225	0,64	<b>Total de Estados Unidos</b>				
2.440	Facebook Inc. - A	828.112	1,57	<b>6.099.296 11,58</b>				
3.261	Fidelity National Information Services Inc.	396.798	0,75	<b>Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda</b>				
8.693	General Motors Company	458.208	0,87	<b>6.099.296 11,58</b>				
1.055	Intuit Inc.	569.183	1,08	<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente</b>				
4.346	JPMorgan Chase & Company	711.396	1,35	<b>6.099.296 11,58</b>				
958	Lam Research Corp.	545.246	1,04	<b>Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>				
2.600	Mastercard Inc. - A	903.968	1,72	<b>Fondos</b>				
200	Mercadolibre Inc.	335.880	0,64	<b>LUXEMBURGO</b>				
6.307	Microsoft Corp.	1.778.070	3,37	184.666	Threadneedle (Lux) - EnhancedCommodities XU*	3.437.705	6,53	
6.267	NextEra Energy Inc.	492.084	0,93	11.532	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds XU*	133.374	0,25	
4.070	Nvidia Corp.	843.140	1,59	6.976	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond XE*	858.648	1,63	
2.520	Paypal Holdings Inc.	655.729	1,25	<b>Total de Luxemburgo</b>				
3.846	Pinterest Inc.	195.954	0,37	<b>4.429.727 8,41</b>				
826	S&P Global Inc.	350.959	0,67	<b>Total de fondos</b>				
1.696	Stryker Corp.	447.269	0,85	<b>4.429.727 8,41</b>				
537	Thermo Fisher Scientific Inc.	306.804	0,58	<b>Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>				
4.893	T-Mobile USA Inc.	625.130	1,19	<b>4.429.727 8,41</b>				
2.635	TransUnion	295.937	0,56					
8.329	Uber Technologies Inc.	373.139	0,71					
2.735	Union Pacific Corp.	536.087	1,02					
3.872	Walt Disney Company	655.026	1,24					
<b>Total de Estados Unidos</b>		<b>21.052.753</b>	<b>39,95</b>					
<b>Total de renta variable</b>		<b>33.185.669</b>	<b>63,02</b>					

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
<b>Otros organismos de inversión colectiva</b>			
<b>Fondos</b>			
<b>REINO UNIDO</b>			
USD	175.062	Threadneedle Specialist Investment Funds ICVC - Emerging Market Local Fund**	529.266 1,01
		<b>Total del Reino Unido</b>	<b>529.266 1,01</b>
		<b>Total de fondos</b>	<b>529.266 1,01</b>
		<b>Total de otros organismos de inversión colectiva</b>	<b>529.266 1,01</b>
		<b>Valor total de las inversiones</b>	<b>45.635.915 86,66</b>
<b>(Coste total: 34.127.410 USD)</b>			

\* Consulte la nota 18.

\*\* Fondo de parte vinculada.

## Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

### Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2021

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Bonos</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>AUSTRALIA</b>				<b>FINLANDIA (continuación)</b>					
EUR	100.000	Aurizon Network Pty Limited 3.13% 01/06/2026	131.058	0,08	EUR	100.000	Teollisuuden Voima Oyj 1.38% 23/06/2028	115.530	0,07
USD	77.000	Ausgrid Finance Pty Limited 4.35% 01/08/2028	86.553	0,05	<b>Total de Finlandia</b>				
USD	105.000	Westpac Banking Corp. FRN 15/11/2035	102.846	0,06	<b>349.616 0,21</b>				
<b>Total de Australia</b>				<b>FRANCIA</b>					
<b>320.457 0,19</b>				EUR	100.000	Altice France SA 2.50% 15/01/2025	114.106	0,07	
<b>BÉLGICA</b>				EUR	100.000	Altice France SA 4.00% 15/07/2029	114.600	0,07	
EUR	100.000	Solvay SA Perp FRN	120.110	0,07	EUR	100.000	Altice France SA 4.13% 15/01/2029	115.184	0,07
EUR	200.000	Solvay SA Perp FRN	247.986	0,16	EUR	104.000	Altice France SA 4.25% 15/10/2029	119.328	0,08
<b>Total de Bélgica</b>				EUR	100.000	Altice France SA 5.88% 01/02/2027	121.638	0,08	
<b>368.096 0,23</b>				EUR	100.000	Banjay Entertainment Sasu 3.50% 01/03/2025	117.368	0,07	
<b>BERMUDAS</b>				EUR	100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.25% 29/06/2028	115.625	0,07	
USD	100.000	Bacardi Limited 5.30% 15/05/2048	130.267	0,08	EUR	100.000	BPCE SA 0.25% 14/01/2031	112.408	0,07
<b>Total de Bermudas</b>				EUR	192.000	CAB Selas 3.38% 01/02/2028	224.825	0,14	
<b>130.267 0,08</b>				EUR	100.000	Casino Guichard Perrachon SA 5.25% 15/04/2027	116.822	0,07	
<b>CANADÁ</b>				EUR	107.000	Casino Guichard Perrachon SA 6.63% 15/01/2026	129.686	0,08	
USD	39.000	Enbridge Inc. 2.50% 01/08/2033	39.233	0,02	EUR	200.000	Casino Guichard-Perrachon SA 4.50% 07/03/2024	233.928	0,15
EUR	172.000	Primo Water Holdings Inc. 3.88% 31/10/2028	207.028	0,13	EUR	100.000	Chrome Holding SASU 5.00% 31/05/2029	119.096	0,07
USD	10.000	Rogers Communications Inc. 3.70% 15/11/2049	10.332	0,01	EUR	139.000	CMA CGM SA 7.50% 15/01/2026	178.823	0,11
<b>Total de Canadá</b>				EUR	314.000	Constellium SE 3.13% 15/07/2029	365.990	0,23	
<b>256.593 0,16</b>				EUR	100.000	Credit Agricole SA 0.50% 21/09/2029	115.067	0,08	
<b>ISLAS CAIMÁN</b>				EUR	100.000	Crown European Holdings SA 2.88% 01/02/2026	123.537	0,08	
GBP	212.000	Southern Water Services Finance Limited 2.38% 28/05/2028	295.777	0,19	EUR	200.000	Electricite de France SA Perp FRN	240.013	0,15
EUR	110.000	UPCB Finance VII Limited 3.63% 15/06/2029	131.202	0,08	EUR	200.000	Electricite de France SA Perp FRN	244.446	0,16
<b>Total de Islas Caimán</b>				EUR	100.000	Electricite de France SA Perp FRN	130.321	0,08	
<b>426.979 0,27</b>				EUR	200.000	Electricite de France SA Perp FRN	258.813	0,17	
<b>DINAMARCA</b>				GBP	200.000	Electricite de France SA Perp FRN	305.891	0,20	
EUR	100.000	Danske Bank AS 0.63% 26/05/2025	118.541	0,07	EUR	100.000	Elior Group SA 3.75% 15/07/2026	120.235	0,07
<b>Total de Dinamarca</b>				EUR	100.000	Elis SA 1.00% 03/04/2025	115.645	0,07	
<b>118.541 0,07</b>				<b>FINLANDIA</b>					
EUR	100.000	Nordea Bank Abp 0.50% 14/05/2027	118.808	0,07	<b>FRANCIA</b>				
EUR	100.000	OP Corporate Bank plc 0.10% 16/11/2027	115.278	0,07	<b>FRANCIA</b>				

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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>FRANCIA (continuación)</b>				<b>ALEMANIA (continuación)</b>					
EUR	100.000	Faurecia 2.38% 15/06/2029	117.333	0,07	EUR	66.000	Deutsche Bank AG FRN 10/06/2026	80.250	0,05
EUR	100.000	Faurecia 3.75% 15/06/2028	120.806	0,08	USD	150.000	Deutsche Bank AG FRN 28/05/2032	152.506	0,10
EUR	300.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2027	350.152	0,22	EUR	100.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 11/02/2025	119.886	0,07
EUR	100.000	Foncia Management SASU 3.38% 31/03/2028	115.909	0,07	EUR	200.000	Deutsche Lufthansa AG 3.00% 29/05/2026	239.383	0,15
EUR	100.000	Iqera Group SAS 6.50% 30/09/2024	119.824	0,07	EUR	100.000	Deutsche Lufthansa AG 3.50% 14/07/2029	119.929	0,07
EUR	100.000	Kapla Holding SAS 3.38% 15/12/2026	116.763	0,07	EUR	100.000	Deutsche Lufthansa AG 3.75% 11/02/2028	122.007	0,08
EUR	100.000	La Financiere Atalian SASU 5.13% 15/05/2025	115.661	0,07	EUR	100.000	Douglas GmbH 6.00% 08/04/2026	117.861	0,07
EUR	100.000	Laboratoire Eimer SE 5.00% 01/02/2029	119.954	0,07	EUR	100.000	Gruenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	121.613	0,08
EUR	182.000	Loxam SAS 3.25% 14/01/2025	213.469	0,13	EUR	100.000	Gruenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	134.991	0,08
EUR	100.000	Loxam SAS 5.75% 15/07/2027	121.280	0,08	EUR	111.000	HT Troplast AG 9.25% 15/07/2025	267.593	0,17
EUR	100.000	Orano SA 3.38% 23/04/2026	126.440	0,08	EUR	210.000	Ineos Styrolution Group GmbH 2.25% 16/01/2027	135.680	0,08
EUR	100.000	Paprec Holding SA 3.50% 01/07/2028	117.735	0,07	EUR	100.000	Infineon Technologies AG Perp FRN	121.602	0,08
EUR	160.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	189.281	0,11	EUR	20.000	K+S AG 4.13% 06/12/2021	23.311	0,01
EUR	163.000	Parts Europe SA 6.50% 16/07/2025	197.424	0,13	EUR	300.000	Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	342.996	0,21
EUR	117.000	Picard Groupe SAS 3.88% 01/07/2026	138.003	0,09	EUR	150.000	Nidda Healthcare Holding GmbH 3.50% 30/09/2024	173.061	0,11
EUR	300.000	Renault SA 2.38% 25/05/2026	352.121	0,22	EUR	215.000	Novelis Sheet Ingot GmbH 3.38% 15/04/2029	260.340	0,16
EUR	100.000	Renault SA 2.50% 01/04/2028	115.897	0,07	EUR	226.000	PCF GmbH 4.75% 15/04/2026	271.071	0,17
EUR	100.000	Rexel SA 2.13% 15/06/2028	119.075	0,07	EUR	191.000	Peach Property Finance GmbH 4.38% 15/11/2025	228.684	0,15
EUR	100.000	SPCM SA 2.63% 01/02/2029	119.128	0,07	EUR	130.000	Progroup AG 3.00% 31/03/2026	152.813	0,10
EUR	100.000	SPIE SA 3.13% 22/03/2024	121.818	0,08	EUR	150.000	Schaeffler AG 2.88% 26/03/2027	188.855	0,12
EUR	100.000	Valeo SA 1.00% 03/08/2028	115.056	0,07	EUR	200.000	Schaeffler AG 3.38% 12/10/2028	259.950	0,16
EUR	100.000	Veolia Environnement SA Perp FRN	119.232	0,07	EUR	100.000	Schaeffler AG 3.38% 12/10/2028	129.975	0,08
		<b>Total de Francia</b>	<b>7.295.756</b>	<b>4,55</b>	EUR	150.000	Schenck Process Holding GmbH/Darmstadt 5.38% 15/06/2023	175.464	0,10
<b>ALEMANIA</b>					EUR	129.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 2.00% 15/07/2025	148.946	0,09
EUR	200.000	Adler Real Estate AG 3.00% 27/04/2026	204.104	0,13	EUR	100.000	Tele Columbus AG 3.88% 02/05/2025	116.611	0,07
EUR	100.000	Amprion GmbH 0.63% 23/09/2033	113.357	0,07	EUR	94.000	thyssenkrupp AG 2.50% 25/02/2025	112.382	0,07
EUR	100.000	Bayer AG 1.13% 06/01/2030	119.115	0,07	EUR	110.000	Thyssenkrupp AG 2.88% 22/02/2024	131.054	0,08
EUR	130.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.50% 11/02/2027	152.663	0,10					
EUR	101.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 4.38% 15/01/2028	121.948	0,08					
EUR	89.000	Commerzbank AG 0.50% 04/12/2026	104.685	0,07					
EUR	100.000	Commerzbank AG FRN 05/12/2030	128.017	0,08					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.





## Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

### Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>LUXEMBURGO (continuación)</b>				<b>LUXEMBURGO (continuación)</b>					
EUR	200.000	Adler Group SA 2.75% 13/11/2026	200.097	0,12	EUR	100.000	Medtronic Global Holdings SCA 1.38% 15/10/2040	117.749	0,07
EUR	100.000	Adler Group SA 3.25% 05/08/2025	102.746	0,06	EUR	47.000	Nestle Finance International Limited 0.63% 14/02/2034	54.286	0,03
EUR	130.000	Altice Financing SA 2.25% 15/01/2025	145.587	0,09	EUR	100.000	Novartis Finance SA 0.00% 23/09/2028	114.311	0,07
EUR	100.000	Altice Financing SA 4.25% 15/08/2029	113.975	0,07	EUR	100.000	Picard Bondco SA 5.38% 01/07/2027	117.119	0,07
EUR	137.000	Altice Finco SA 4.75% 15/01/2028	151.825	0,09	EUR	100.000	Sani/Ikos Financial Holdings 1 Sarl 5.63% 15/12/2026	118.630	0,07
EUR	264.000	Altice France Holding SA 8.00% 15/05/2027	326.426	0,21	EUR	100.000	Telecom Italia Finance SA 7.75% 24/01/2033	169.593	0,11
EUR	198.000	ARD Finance SA 5.00% 30/06/2027	238.938	0,15	EUR	100.000	Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl 3.50% 01/03/2028	120.237	0,07
GBP	120.000	Aroundtown SA 3.00% 16/10/2029	171.999	0,11			<b>Total de Luxemburgo</b>	<b>5.201.568</b>	<b>3,23</b>
GBP	140.000	B&M European Value Retail SA 3.63% 15/07/2025	194.627	0,12			<b>MÉXICO</b>		
EUR	100.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.34% 13/08/2041	111.696	0,07	EUR	100.000	Petroleos Mexicanos 2.75% 21/04/2027	109.425	0,07
EUR	141.000	Canpack SA 2.38% 01/11/2027	167.074	0,10	EUR	137.000	Petroleos Mexicanos 3.75% 21/02/2024	164.260	0,10
EUR	100.000	Cidron Aida Finco Sarl 5.00% 01/04/2028	116.936	0,08	EUR	149.000	Petroleos Mexicanos 4.75% 26/02/2029	171.562	0,11
EUR	100.000	Cirsa Finance International Sarl 4.50% 15/03/2027	114.959	0,07	EUR	140.000	Petroleos Mexicanos 4.88% 21/02/2028	164.476	0,10
EUR	121.000	Cirsa Finance International Sarl 4.75% 22/05/2025	140.897	0,09	USD	50.000	Petroleos Mexicanos 6.88% 04/08/2026	54.392	0,03
EUR	180.024	Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	212.219	0,13			<b>Total de México</b>	<b>664.115</b>	<b>0,41</b>
EUR	134.000	Crystal Almond Sarl 4.25% 15/10/2024	158.969	0,10			<b>PAÍSES BAJOS</b>		
EUR	100.000	Flamingo Lux II 5.00% 31/03/2029	115.144	0,07	EUR	137.000	Ashland Services BV 2.00% 30/01/2028	164.410	0,10
GBP	176.000	Garfunkelux Holdingco 3 SA 7.75% 01/11/2025	248.597	0,16	EUR	100.000	Cooperatieve Rabobank UA 1.38% 03/02/2027	124.708	0,08
EUR	108.000	Groupe Ecore Holding SAS FRN 15/11/2023	127.398	0,08	EUR	100.000	Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	118.142	0,07
EUR	150.000	Hanesbrands Inc. 3.50% 15/06/2024	185.713	0,12	EUR	100.000	Dufry One BV 3.38% 15/04/2028	115.359	0,07
EUR	123.000	Holcim Finance Luxembourg SA Perp FRN	149.510	0,09	GBP	68.000	E.ON International Finance BV 6.25% 03/06/2030	122.146	0,08
EUR	100.000	HSE Finance Sarl 5.63% 15/10/2026	120.784	0,08	EUR	100.000	Enexis Holding NV 0.75% 02/07/2031	119.937	0,07
EUR	284.000	InPost SA 2.25% 15/07/2027	333.064	0,21	EUR	100.000	Goodyear Europe BV 2.75% 15/08/2028	117.050	0,07
EUR	100.000	Kleopatra Finco Sarl 4.25% 01/03/2026	113.780	0,07	EUR	100.000	Iberdrola International BV Perp FRN	116.531	0,07
EUR	198.000	Lincoln Financing SARL 3.63% 01/04/2024	231.773	0,14	EUR	100.000	ING Groep NV 0.38% 29/09/2028	114.765	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				
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>							
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>							
<b>PAÍSES BAJOS (continuación)</b>				<b>PANAMÁ</b>							
EUR	128.000	Intertrust Group BV 3.38% 15/11/2025	151.080	0,09	EUR	201.000	Carnival Corp. 7.63% 01/03/2026	252.428	0,16		
EUR	264.000	Nobel Bidco BV 3.13% 15/06/2028	304.728	0,19	<b>Total de Panamá</b>						
EUR	100.000	Oci NV 3.63% 15/10/2025	120.498	0,08	<b>252.428 0,16</b>						
EUR	167.000	PPF Telecom Group BV 3.25% 29/09/2027	210.612	0,13	<b>PORTUGAL</b>						
EUR	174.000	Repsol International Finance BV FRN 25/03/2075	219.958	0,14	EUR	100.000	Edp - Energias de Portugal SA FRN 30/04/2079	125.927	0,08		
EUR	124.000	Repsol International Finance BV Perp FRN	144.531	0,09	EUR	100.000	EDP - Energias de Portugal SA 1.50% 14/03/2082	114.147	0,07		
EUR	100.000	Repsol International Finance BV Perp FRN	127.327	0,08	<b>Total de Portugal</b>						
EUR	100.000	Stedin Holding NV Perp FRN	118.085	0,07	<b>240.074 0,15</b>						
EUR	131.619	Summer Bidco BV 9.00% 15/11/2025	156.315	0,10	<b>RUMANÍA</b>						
EUR	118.083	Summer Bidco BV 9.00% 15/11/2025	140.240	0,09	EUR	100.000	RCS & RDS SA 3.25% 05/02/2028	116.093	0,07		
EUR	100.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	113.070	0,07	<b>Total de Rumanía</b>						
EUR	100.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	119.912	0,07	<b>116.093 0,07</b>						
EUR	500.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	629.755	0,40	<b>ESPAÑA</b>						
EUR	100.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	128.746	0,08	EUR	100.000	Caixabank SA 0.38% 03/02/2025	117.457	0,07		
EUR	287.000	Tennet Holding BV Perp FRN	349.186	0,23	EUR	100.000	Cellnex Finance Company 2.00% 15/02/2033	113.416	0,07		
EUR	105.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.25% 31/03/2023	119.734	0,07	EUR	100.000	Cellnex Finance Company SA 1.00% 15/09/2027	113.970	0,07		
EUR	100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.63% 15/10/2028	105.070	0,07	EUR	100.000	Cellnex Finance Company SA 1.25% 15/01/2029	113.127	0,07		
EUR	100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.50% 01/03/2025	120.412	0,07	EUR	100.000	Cellnex Finance Company SA 1.50% 08/06/2028	116.206	0,07		
EUR	180.000	United Group BV 4.63% 15/08/2028	209.912	0,13	EUR	100.000	Cellnex Telecom SA 1.88% 26/06/2029	117.612	0,08		
EUR	100.000	UPC Holding BV 3.88% 15/06/2029	119.235	0,07	EUR	144.000	Grifols Escrow Issuer SA 3.88% 15/10/2028	169.056	0,10		
EUR	100.000	Volkswagen International Finance NV 3.25% 18/11/2030	140.822	0,09	EUR	100.000	Grifols SA 2.25% 15/11/2027	116.517	0,07		
EUR	200.000	Vz Vendor Financing II BV 2.88% 15/01/2029	229.814	0,15	<b>Total de España</b>						
EUR	100.000	ZF Europe Finance BV 3.00% 23/10/2029	120.774	0,08	<b>977.361 0,60</b>						
<b>Total de Países Bajos</b>				<b>5.312.864</b>	<b>3,32</b>	<b>SUECIA</b>					
<b>NORUEGA</b>				EUR				100.000	Akelius Residential Property AB FRN 05/10/2078	122.453	0,08
USD	244.000	Kommunalbanken AS 0.38% 11/09/2025	239.649	0,15	EUR	162.000	Heimstaden Bostad AB Perp FRN	183.574	0,11		
<b>Total de Noruega</b>				<b>239.649</b>	<b>0,15</b>	EUR	100.000	Heimstaden Bostad AB Perp FRN	114.790	0,07	
				EUR				100.000	Heimstaden Bostad AB Perp FRN	119.093	0,07
				EUR				100.000	Heimstaden Bostad AB Perp FRN	119.086	0,07
				EUR				100.000	Intrum AB 3.00% 15/09/2027	115.844	0,07
				EUR				135.000	Intrum AB 3.50% 15/07/2026	160.384	0,10
				EUR				100.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	119.116	0,07
				EUR				100.000	Sagax AB 2.25% 13/03/2025	123.123	0,08

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

### Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>			
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>			
<b>SUECIA (continuación)</b>				<b>REINO UNIDO (continuación)</b>			
EUR	104.000 Samhallsbyggnadsbolaget Perp FRN	120.826	0,08	EUR	123.000 Ineos Finance plc 2.88% 01/05/2026	144.083	0,09
USD	200.000 Swedish Export Credit FRN 25/05/2023	202.498	0,13	EUR	186.000 Ineos Finance plc 3.38% 31/03/2026	220.679	0,15
EUR	199.000 Verisure Holding AB 3.25% 15/02/2027	232.264	0,15	EUR	100.000 Ineos Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	117.233	0,07
EUR	100.000 Verisure Holding AB 3.88% 15/07/2026	119.061	0,07	EUR	119.000 Ineos Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	139.508	0,09
EUR	155.000 Verisure Midholding AB 5.25% 15/02/2029	184.727	0,11	GBP	100.000 Inspired Entertainment Financing plc 7.88% 01/06/2026	138.881	0,08
	<b>Total de Suecia</b>	<b>2.036.839</b>	<b>1,26</b>	EUR	100.000 International Game Technology plc 3.50% 15/07/2024	122.026	0,08
<b>SUIZA</b>				EUR	190.000 International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	226.313	0,14
EUR	100.000 Credit Suisse Group AG 0.63% 18/01/2033	109.301	0,07	GBP	287.000 Iron Mountain UK plc 3.88% 15/11/2025	392.056	0,24
USD	200.000 UBS AG 5.13% 15/05/2024	219.156	0,14	EUR	100.000 Jaguar Land Rover Automotive plc 4.50% 15/07/2028	114.508	0,07
	<b>Total de Suiza</b>	<b>328.457</b>	<b>0,21</b>	EUR	136.000 Jaguar Land Rover Automotive plc 5.88% 15/11/2024	168.501	0,10
<b>REINO UNIDO</b>				EUR	100.000 Jaguar Land Rover Automotive plc 6.88% 15/11/2026	129.384	0,08
GBP	105.000 Arrow Global Finance 5.13% 15/09/2024	141.937	0,09	GBP	100.000 Jerrold Finco plc 5.25% 15/01/2027	140.612	0,09
GBP	167.000 Boparan Finance plc 7.63% 30/11/2025	199.366	0,13	GBP	32.000 Lloyds TSB Bank plc 7.63% 22/04/2025	52.659	0,03
USD	125.000 Bp Capital Markets plc Perp FRN	133.431	0,08	GBP	101.000 Marks & Spencer plc 3.75% 19/05/2026	142.100	0,09
EUR	142.000 BP Capital Markets plc Perp FRN	176.014	0,11	EUR	192.000 Modulaire Global Finance plc 6.50% 15/02/2023	226.721	0,14
GBP	75.000 Broadgate Financing plc 5.00% 05/10/2031	115.932	0,07	EUR	100.000 National Grid Electricity Transmission plc 0.82% 07/07/2032	116.989	0,07
EUR	100.000 Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	115.912	0,07	EUR	100.000 Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	114.989	0,07
GBP	100.000 Constellation Automotive Financing plc 4.88% 15/07/2027	134.077	0,08	EUR	100.000 Natwest Group plc FRN 26/02/2030	115.891	0,07
GBP	167.000 Co-Operative Group Limited 5.13% 17/05/2024	240.187	0,16	EUR	100.000 Nomad Foods Bondco plc 2.50% 24/06/2028	117.936	0,07
GBP	237.000 Deuce Finco plc 5.50% 15/06/2027	324.140	0,20	EUR	200.000 Pinnacle Bidco plc 5.50% 15/02/2025	238.972	0,15
EUR	155.000 DS Smith plc 0.88% 12/09/2026	183.902	0,11	GBP	100.000 Premier Foods Finance plc 3.50% 15/10/2026	136.104	0,08
EUR	185.000 EC Finance plc 2.38% 15/11/2022	215.592	0,13	GBP	204.000 Punch Finance plc 6.13% 30/06/2026	282.066	0,18
EUR	15.000 EC Finance plc 2.38% 15/11/2022	17.480	0,01	EUR	100.000 Rolls-Royce plc 4.63% 16/02/2026	128.612	0,08
EUR	109.000 EC Finance plc 3.00% 15/10/2026	127.340	0,08	GBP	100.000 Rolls-Royce plc 5.75% 15/10/2027	150.159	0,09
EUR	171.000 EG Global Finance plc 4.38% 07/02/2025	197.429	0,13				
USD	74.552 Enquest plc 7.00% 15/04/2022	71.989	0,04				
EUR	19.000 HBOS plc FRN 18/03/2030	25.055	0,02				
GBP	39.000 HSBC Bank plc 5.38% 22/08/2033	68.524	0,04				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

### Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>REINO UNIDO (continuación)</b>				<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>					
GBP	15.000	Santander UK plc Perp 10.06% 10/12/2033	36.077	0,02	USD	34.000	Astrazeneca Finance LLC 2.25% 28/05/2031	34.592	0,02
GBP	100.000	Telereal Securitisation plc FRN 10/12/2033	136.268	0,08	USD	15.000	AT&T Inc. 3.50% 01/06/2041	15.411	0,01
GBP	94.464	Tesco Property Finance 3 plc 5.74% 13/04/2040	167.156	0,10	USD	119.000	AT&T Inc. 3.50% 15/09/2053	117.920	0,07
GBP	100.000	Travis Perkins plc 3.75% 17/02/2026	143.570	0,09	USD	91.000	AT&T Inc. 4.90% 15/08/2037	110.852	0,07
EUR	100.000	Victoria plc 3.63% 26/08/2026	118.822	0,07	EUR	158.000	Avantor Funding Inc. 2.63% 01/11/2025	187.602	0,12
EUR	105.000	Victoria plc 3.75% 15/03/2028	125.114	0,08	USD	30.000	Bank of America Corp. FRN 21/07/2032	29.578	0,02
GBP	181.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.25% 15/05/2029	258.712	0,17	USD	53.000	Bank of America Corp. FRN 13/02/2031	53.655	0,03
EUR	222.000	Vmed O2 UK Financing I plc 3.25% 31/01/2031	264.734	0,16	USD	136.000	Bank of America Corp. FRN 29/04/2031	138.818	0,09
EUR	100.000	Vodafone Group plc FRN 27/08/2080	120.116	0,07	USD	106.000	Bank of America Corp. FRN 11/03/2032	107.977	0,07
EUR	100.000	Vodafone Group plc FRN 27/08/2080	119.576	0,07	USD	42.000	Bank of America Corp. FRN 23/07/2030	44.739	0,03
GBP	155.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	225.468	0,14	USD	137.000	BAT Capital Corp. 4.70% 02/04/2027	154.894	0,10
USD	231.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	254.313	0,16	EUR	100.000	Becton Dickinson and Company 1.90% 15/12/2026	125.379	0,08
USD	159.000	Vodafone Group plc FRN 04/04/2079	194.676	0,12	USD	56.000	Berkshire Hathaway Finance Corp 4.25% 15/01/2049	68.821	0,04
		<b>Total del Reino Unido</b>	<b>8.529.891</b>	<b>5,28</b>	USD	25.000	Boeing Company 3.95% 01/08/2059	25.530	0,02
					USD	30.000	Boeing Company 5.93% 01/05/2060	41.050	0,03
<b>ESTADOS UNIDOS</b>				<b>ESTADOS UNIDOS</b>					
USD	83.000	AbbVie Inc. 4.25% 21/11/2049	98.077	0,06	USD	28.000	Broadcom Inc. 4.15% 15/11/2030	31.027	0,02
USD	32.000	AbbVie Inc. 4.88% 14/11/2048	41.053	0,03	USD	52.000	Broadcom Inc. 5.00% 15/04/2030	60.815	0,04
USD	22.000	AEP Texas Inc. 3.45% 15/05/2051	22.878	0,01	EUR	200.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 2.38% 01/03/2028	235.112	0,15
USD	70.000	Amazon.com Inc. 3.10% 12/05/2051	73.721	0,05	USD	57.000	Charter Communications Operating LLC 3.95% 30/06/2062	55.162	0,03
USD	35.000	Amgen Inc. 3.15% 21/02/2040	35.770	0,02	USD	21.000	Cigna Corp. 4.90% 15/12/2048	26.817	0,02
USD	148.000	Anheuser-Busch Companies LLC 4.70% 01/02/2036	179.015	0,11	USD	150.000	Citigroup Inc. FRN 31/03/2031	173.016	0,12
USD	50.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc. 4.35% 01/06/2040	58.339	0,04	USD	15.000	Consolidated Edison Co of NY 3.95% 01/04/2050	17.115	0,01
USD	28.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc. 5.45% 23/01/2039	36.266	0,02	USD	41.000	CSX Corp. 3.80% 15/04/2050	46.626	0,03
USD	81.000	Apple Inc. 2.65% 11/05/2050	78.180	0,05	USD	33.000	CVS Health Corp. 5.05% 25/03/2048	42.577	0,03
EUR	119.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 2.00% 01/09/2028	139.322	0,09	EUR	100.000	Digital Euro Finco LLC 2.50% 16/01/2026	126.610	0,08
EUR	210.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 3.00% 01/09/2029	244.378	0,15	USD	46.000	Duke Energy Progress Inc. 4.20% 15/08/2045	54.832	0,03
					USD	30.000	Emera USA Finance LP 4.75% 15/06/2046	35.425	0,02
					USD	53.000	Enterprise Products Operating LLC 4.45% 15/02/2043	61.086	0,04

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

### Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>			
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>			
<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>				<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>			
USD	94.000 Eversource Energy 2.55% 15/03/2031	95.886	0,06	GBP	100.000 Kraft Heinz Foods Company 4.13% 01/07/2027	150.425	0,09
USD	25.000 Eversource Energy 3.45% 15/01/2050	26.321	0,02	USD	31.000 Kraft Heinz Foods Company 4.38% 01/06/2046	35.379	0,02
USD	31.000 Eversource Energy 3.45% 15/01/2050	32.639	0,02	USD	25.000 Microsoft Corp. 4.10% 06/02/2037	30.520	0,02
USD	20.000 Federal Home Loan Banks 5.50% 15/07/2036	29.034	0,02	GBP	173.000 MPT Operating Partnership LP 3.69% 05/06/2028	248.841	0,15
USD	15.000 Fedex Corp. 4.95% 17/10/2048	19.004	0,01	EUR	203.000 Netflix Inc. 3.63% 15/05/2027	272.319	0,17
EUR	100.000 Fidelity National Information Services Inc. 1.50% 21/05/2027	122.969	0,08	EUR	200.000 Netflix Inc. 3.63% 15/05/2027	268.295	0,17
EUR	100.000 Fiserv Inc. 1.13% 01/07/2027	121.108	0,08	EUR	140.000 Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	194.833	0,12
EUR	100.000 Ford Motor Credit Company LLC 1.36% 07/02/2025	115.460	0,07	EUR	253.000 Netflix Inc. 4.63% 15/05/2029	368.257	0,22
EUR	196.000 Ford Motor Credit Company LLC 2.33% 25/11/2025	234.033	0,15	USD	25.000 Nisource Finance Corp. 4.38% 15/05/2047	29.773	0,02
EUR	100.000 Ford Motor Credit Company LLC 2.39% 17/02/2026	119.743	0,07	USD	115.000 Nisource Finance Corp. 4.80% 15/02/2044	143.400	0,09
GBP	100.000 Ford Motor Credit Company LLC 2.75% 14/06/2024	136.476	0,08	EUR	100.000 Olympus Water USA 3.88% 01/10/2028	116.181	0,07
EUR	323.000 Ford Motor Credit Company LLC 3.02% 06/03/2024	390.970	0,25	EUR	100.000 Olympus Water USA 5.38% 01/10/2029	114.760	0,07
GBP	100.000 Ford Motor Credit Company LLC 4.54% 06/03/2025	143.861	0,09	USD	69.000 Oracle Corp. 3.60% 01/04/2040	71.461	0,04
EUR	110.000 General Electric Company 4.13% 19/09/2035	172.520	0,11	USD	41.000 Oracle Corp. 3.65% 25/03/2041	42.533	0,03
EUR	100.000 General Motors Financial Company Inc. 0.60% 20/05/2027	115.687	0,07	EUR	100.000 Organon & Company 2.88% 30/04/2028	118.536	0,07
USD	19.000 Georgia Power Company 3.70% 30/01/2050	20.481	0,01	USD	78.000 Pacific Gas and Electric Company 4.95% 01/07/2050	82.721	0,05
USD	40.000 Goldman USA Finance Three LLC 3.70% 15/03/2028	43.367	0,03	USD	20.000 Piedmont Natural Gas Company Inc. 3.35% 01/06/2050	20.596	0,01
USD	22.000 Intel Corp. 3.05% 12/08/2051	21.872	0,01	USD	39.000 Plains All American Pipeline LP 3.55% 15/12/2029	41.033	0,03
USD	36.000 Intel Corp. 4.75% 25/03/2050	47.150	0,03	USD	39.000 Plains All American Pipeline LP 4.70% 15/06/2044	41.696	0,03
EUR	200.000 Iqvia Inc. 2.25% 15/01/2028	233.769	0,15	USD	33.000 PPL Electric Utilities Corp 4.15% 15/06/2048	40.272	0,03
EUR	216.000 Iqvia Inc. 2.25% 15/03/2029	251.980	0,16	USD	40.000 Relx Capital Inc. 3.50% 16/03/2023	41.690	0,03
USD	40.000 JPMorgan Chase & Company FRN 04/02/2032	38.629	0,02	USD	30.000 San Diego Gas & Electric Company 3.32% 15/04/2050	31.714	0,02
USD	45.000 JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2032	45.633	0,03	USD	37.000 San Diego Gas & Electric Company 4.15% 15/05/2048	44.208	0,03
USD	125.000 JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2041	129.239	0,08	EUR	100.000 Scientific Games International Inc. 5.50% 15/02/2026	119.823	0,07
USD	58.000 JPMorgan Chase & Company FRN 24/07/2038	66.150	0,04	EUR	129.000 Silgan Holdings Inc. 3.25% 15/03/2025	150.849	0,09
USD	29.000 Kimco Realty Corp. 2.25% 01/12/2031	28.383	0,02	USD	42.000 Southern California Edison Company 4.13% 01/03/2048	45.973	0,03
USD	78.000 Kinder Morgan Energy Partners LP 5.00% 01/03/2043	92.384	0,05	USD	19.000 Southern Company 4.40% 01/07/2046	22.430	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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)</b>					
<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>				<b>FRANCIA</b>					
EUR	121.000	Spectrum Brands Inc. 4.00% 01/10/2026	143.531	0,09	EUR	100.000	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0.00% 25/02/2028	116.866	0,07
GBP	50.000	Time Warner Cable Inc. 5.75% 02/06/2031	85.580	0,05	USD	200.000	Caisse D'amortissement de la Dette Sociale 0.38% 23/09/2025	196.461	0,12
USD	17.000	Tyson Foods Inc. 4.55% 02/06/2047	20.862	0,01	USD	200.000	Caisse D'amortissement de la Dette Sociale 1.00% 21/10/2030	189.022	0,12
USD	30.000	Verizon Communications Inc. 2.55% 21/03/2031	30.403	0,02	USD	200.000	Caisse D'amortissement de la Dette Sociale 1.38% 20/01/2031	194.657	0,12
USD	40.000	Verizon Communications Inc. 2.65% 20/11/2040	37.680	0,02	EUR	43.019	France (Govt Of) 0.50% 25/06/2044	47.671	0,03
USD	27.000	Verizon Communications Inc. 3.70% 22/03/2061	28.586	0,02	EUR	17.000	France (Govt Of) 0.75% 25/05/2053	18.595	0,01
USD	101.000	Verizon Communications Inc. 4.40% 01/11/2034	119.496	0,07	EUR	54.000	France (Govt of) OAT 1.25% 25/05/2034	69.728	0,04
USD	50.000	Williams Companies Inc. 4.85% 01/03/2048	61.063	0,04	EUR	58.000	France (Govt of) OAT 1.50% 25/05/2031	76.360	0,05
		<b>Total de Estados Unidos</b>	<b>9.540.504</b>	<b>5,96</b>	EUR	100.000	Unedic Asseo 0.25% 16/07/2035	112.927	0,07
						<b>Total de Francia</b>	<b>1.022.287</b>	<b>0,63</b>	
<b>ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)</b>				<b>ALEMANIA</b>					
USD	200.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 5.13% 15/05/2024	215.686	0,13	EUR	9.000	Germany (Govt of) 0.00% 15/05/2035	10.435	0,01
		<b>Total de Islas Vírgenes (Británicas)</b>	<b>215.686</b>	<b>0,13</b>	EUR	28.000	Germany (Govt of) 0.00% 15/08/2050	29.974	0,02
<b>Total de bonos</b>			<b>54.799.855</b>	<b>34,10</b>		<b>Total de Alemania</b>	<b>40.409</b>	<b>0,03</b>	
<b>Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda</b>				<b>ITALIA</b>					
<b>AUSTRIA</b>				USD 200.000 Italy (Govt of) BPT 1.25% 17/02/2026				197.396	0,12
EUR	5.000	Austria (Govt of) 0.85% 30/06/2120	5.189	0,00	EUR	21.000	Italy (Govt of) BPT 1.50% 30/04/2045	23.715	0,01
		<b>Total de Austria</b>	<b>5.189</b>	<b>0,00</b>	EUR	43.000	Italy (Govt of) BPT 1.70% 01/09/2051	48.643	0,03
<b>BÉLGICA</b>				EUR 26.000 Italy (Govt of) BPT 1.80% 01/03/2041				31.456	0,02
EUR	11.000	Belgium (Govt of) 1.70% 22/06/2050	15.352	0,01	EUR	32.000	Italy (Govt of) BPT 2.15% 01/03/2072	36.361	0,02
		<b>Total de Bélgica</b>	<b>15.352</b>	<b>0,01</b>		<b>Total de Italia</b>	<b>337.571</b>	<b>0,20</b>	
<b>CANADÁ</b>				<b>JAPÓN</b>					
CAD	60.000	Canada (Govt of) 2.75% 01/12/2048	55.157	0,03	JPY	15.100.000	Japan (Govt of) Forty Year Bond 0.40% 20/03/2056	122.699	0,08
CAD	200.000	Canada Housing Trust No 1 1.10% 15/03/2031	148.035	0,09	JPY	3.600.000	Japan (Govt of) Thirty Year Bond 0.40% 20/06/2049	30.406	0,02
USD	80.000	Province of Ontario Canada 1.13% 07/10/2030	75.967	0,05	JPY	3.200.000	Japan (Govt of) Thirty Year Bond 0.40% 20/03/2050	26.861	0,02
		<b>Total de Canadá</b>	<b>279.159</b>	<b>0,17</b>					

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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)</b>				<b>Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)</b>					
<b>JAPÓN (continuación)</b>				<b>SUPRANACIONAL (continuación)</b>					
JPY	18.600.000	Japan (Govt of) Thirty Year Bond 0.60% 20/09/2050	164.270	0,10	USD	80.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.88% 14/05/2030	76.189	0,05
<b>Total de Japón</b>			<b>344.236</b>	<b>0,22</b>	USD	100.000	International Bank for Reconstruction & Development 1.88% 27/10/2026	104.247	0,06
<b>MÉXICO</b>				<b>REINO UNIDO</b>					
USD	2.000.000	Mexico (Govt of) Bonos 5.75% 12/10/2110	2.277.801	1,43	GBP	17.000	United Kingdom Gilt 0.13% 31/01/2028	22.036	0,01
<b>Total de México</b>			<b>2.277.801</b>	<b>1,43</b>	GBP	8.000	United Kingdom Gilt 0.50% 22/10/2061	8.156	0,01
<b>SUDÁFRICA</b>				<b>ESTADOS UNIDOS</b>					
ZAR	3.100.000	South Africa (Govt of) 8.25% 31/03/2032	184.146	0,11	USD	35.000	United States Treasury N/B 0.25% 15/06/2024	34.809	0,02
<b>Total de Sudáfrica</b>			<b>184.146</b>	<b>0,11</b>	USD	155.000	United States Treasury N/B 0.50% 31/10/2027	148.764	0,09
<b>ESPAÑA</b>				<b>Total del Reino Unido</b>					
EUR	45.000	Instituto de Credito Oficial 0.00% 30/04/2027	52.578	0,03	GBP	52.000	United Kingdom Gilt 0.63% 31/07/2035	64.522	0,04
EUR	9.000	Spain (Govt of) 0.10% 30/04/2031	10.154	0,01	GBP	21.000	United Kingdom Gilt 0.88% 31/07/2033	27.631	0,02
EUR	11.000	Spain (Govt of) 1.00% 30/07/2042	12.585	0,01	GBP	42.820	United Kingdom Gilt 0.88% 31/01/2046	51.348	0,03
EUR	19.000	Spain (Govt of) 1.45% 31/10/2071	19.628	0,01	GBP	29.000	United Kingdom Gilt 1.13% 31/01/2039	37.599	0,02
EUR	48.000	Spain (Govt of) 2.90% 31/10/2046	76.147	0,05	GBP	34.000	United Kingdom Gilt 1.25% 22/10/2041	44.835	0,03
<b>Total de España</b>			<b>171.092</b>	<b>0,11</b>	GBP	24.000	United Kingdom Gilt 1.25% 31/07/2051	31.136	0,02
<b>SUPRANACIONAL</b>				<b>Total del Reino Unido</b>					
USD	80.000	Asian Development Bank 0.75% 08/10/2030	74.767	0,05	GBP	34.000	United Kingdom Gilt 1.75% 22/01/2049	49.579	0,03
USD	124.000	Asian Development Bank 1.75% 19/09/2029	126.922	0,08	<b>Total del Reino Unido</b>			<b>336.842</b>	<b>0,21</b>
USD	25.000	European Investment Bank 0.63% 21/10/2027	24.194	0,02	<b>ESTADOS UNIDOS</b>				
USD	25.000	European Investment Bank 1.63% 13/05/2031	25.183	0,02	USD	130.000	United States Treasury N/B 0.75% 31/05/2026	128.923	0,08
EUR	8.000	European Union 0.10% 04/10/2040	8.670	0,01	USD	132.000	United States Treasury N/B 0.75% 31/01/2028	128.164	0,08
EUR	18.000	IBRD 0.20% 21/01/2061	17.481	0,01	USD	145.000	United States Treasury N/B 1.00% 31/07/2028	142.179	0,08
USD	40.000	Inter-American Development Bank 1.13% 13/01/2031	38.594	0,02	USD	210.600	United States Treasury N/B 1.13% 15/08/2040	181.215	0,11
USD	150.000	Inter-American Development Bank 3.00% 21/02/2024	159.240	0,10					
USD	250.000	International Bank for Reconstruction & Development FRN 18/09/2025	251.178	0,16					
USD	135.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.75% 11/03/2025	135.369	0,08					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.



## Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

### Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)</b>				<b>Renta variable (continuación)</b>					
<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>				<b>ISLAS CAIMÁN (continuación)</b>					
USD	409.000	United States Treasury N/B 1.25% 15/05/2050	334.742	0,22	46.000	China Mengniu Dairy Company Limited	296.340	0,18	
USD	75.000	United States Treasury N/B 1.38% 15/11/2040	67.365	0,04	64.000	China Resources Land Limited	270.070	0,17	
USD	142.400	United States Treasury N/B 1.38% 15/08/2050	120.217	0,07	3.994	NetEase Inc. - ADR	341.088	0,21	
<b>Total de Estados Unidos</b>			<b>1.286.378</b>	<b>0,79</b>	59.600	Sands China Limited	122.498	0,08	
					4.100	Tencent Holdings Limited	243.009	0,15	
					<b>Total de Islas Caimán</b>			<b>1.486.591</b>	<b>0,92</b>
<b>Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda</b>				<b>7.586.153</b>	<b>4,72</b>	<b>CHINA</b>			
<b>Renta variable</b>						148.300	Baoshan Iron & Steel Company Limited - A	199.909	0,12
<b>AUSTRALIA</b>						302.000	China Construction Bank Corp. Company Limited - H	216.472	0,13
9.317	Aristocrat Leisure Limited	315.979	0,19	47.000	China Merchants Bank Company Limited - H	374.628	0,23		
18.238	Australia & New Zealand Banking Group Limited	370.854	0,23	13.100	Gree Electric Appliances Inc. - A	78.653	0,05		
2.597	Carsales.Com Limited	47.536	0,03	35.100	Inner Mongolia Yili Industrial Group Company Limited - A	205.031	0,13		
33.918	Dexus Property Group	264.607	0,16	34.500	Ping An Insurance Group Company of China Limited	235.993	0,15		
15.512	Fortescue Metals Group Limited	167.628	0,10	60.000	Times Property Holdings Limited	49.867	0,03		
3.316	Macquarie Group Limited	435.947	0,27	3.700	Wuliangye Yibin Company Limited - A	125.774	0,08		
13.758	Oz Minerals Limited	223.706	0,14	<b>Total de China</b>			<b>1.486.327</b>	<b>0,92</b>	
28.948	Sydney Airport Finance Company Pty Limited	172.303	0,11	<b>DINAMARCA</b>					
31.378	Transurban Group	320.949	0,20	16.400	Tryg A/S	372.931	0,23		
<b>Total de Australia</b>			<b>2.319.509</b>	<b>1,43</b>	<b>Total de Dinamarca</b>			<b>372.931</b>	<b>0,23</b>
<b>BÉLGICA</b>						<b>FINLANDIA</b>			
910	Aedifica	113.691	0,07	2.753	Neste Oyj	156.243	0,10		
3.414	KBC Group NV	308.777	0,19	4.992	Upm-Kymmene Oyj	177.672	0,11		
2.593	Melexis NV	276.474	0,17	<b>Total de Finlandia</b>			<b>333.915</b>	<b>0,21</b>	
<b>Total de Bélgica</b>			<b>698.942</b>	<b>0,43</b>	<b>FRANCIA</b>				
<b>CANADÁ</b>						1.065	Air Liquide SA	171.047	0,11
555	Canadian National Railway Company	64.303	0,04	2.100	Antin Infrastructure Partners SA	70.823	0,04		
3.486	Manulife Financial Corp.	67.087	0,04	10.746	AXA SA	299.956	0,19		
517	Ritchie Bros Auctioneers Inc.	31.878	0,02	1.391	BNP Paribas	89.375	0,06		
2.743	Suncor Energy Inc.	56.858	0,04	3.167	Edenred	171.151	0,11		
<b>Total de Canadá</b>			<b>220.126</b>	<b>0,14</b>	458	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	329.149	0,20	
<b>ISLAS CAIMÁN</b>						4.577	Nexity	218.546	0,14
19.300	ASM Pacific Technology Limited	213.586	0,13						

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

### Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>			
<b>Renta variable (continuación)</b>				<b>Renta variable (continuación)</b>			
<b>FRANCIA (continuación)</b>				<b>IRLANDA</b>			
731	Pernod-Ricard SA	161.560	0,10	1.281	CRH plc	60.216	0,04
1.464	Schneider Electric SE	244.156	0,16	5.095	CRH plc	239.757	0,14
8.688	TotalEnergies SE	416.200	0,25	7.585	Eaton Corp. plc	1.132.516	0,70
8.108	Verallia Sasu	280.024	0,17	690	Experian plc	28.925	0,02
3.206	Vinci SA	334.961	0,20	176	Linde plc	51.635	0,03
	<b>Total de Francia</b>	<b>2.786.948</b>	<b>1,73</b>	2.528	Medtronic Inc.	316.885	0,20
					<b>Total de Irlanda</b>	<b>1.829.934</b>	<b>1,13</b>
<b>ALEMANIA</b>				<b>ITALIA</b>			
3.279	Brenntag AG	306.219	0,19	30.647	Enel SpA	236.232	0,15
3.123	Deutsche Telekom AG - Reg	62.963	0,04	15.031	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	167.861	0,10
3.779	E.ON AG	46.284	0,03	10.944	Nexi SpA	204.966	0,12
1.259	Evonik Industries AG	39.790	0,02		<b>Total de Italia</b>	<b>609.059</b>	<b>0,37</b>
219	Muenchener Ruckversicherungs AG - Reg	60.128	0,04				
2.401	Siemens AG - Reg	394.912	0,25	<b>JAPÓN</b>			
1.671	Siemens Healthineers AG	108.798	0,07	200	Disco Corp.	56.195	0,03
1.103	Volkswagen AG Pfd	247.534	0,15	700	Rohm Company Limited	66.753	0,04
2.686	Vonovia SE	161.562	0,10		<b>Total de Japón</b>	<b>122.948</b>	<b>0,07</b>
	<b>Total de Alemania</b>	<b>1.428.190</b>	<b>0,89</b>	<b>JERSEY - ISLAS DEL CANAL</b>			
<b>HONG KONG</b>				23.546	WPP plc	317.641	0,20
38.000	AIA Group Limited	439.082	0,27		<b>Total de Jersey - Islas del Canal</b>	<b>317.641</b>	<b>0,20</b>
6.700	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	412.949	0,26	<b>LUXEMBURGO</b>			
21.000	Sun Hung Kai Properties Limited	262.748	0,16	4.292	Trinseo SA	231.682	0,14
75.000	Xinyi Glass Holdings Limited	224.480	0,14		<b>Total de Luxemburgo</b>	<b>231.682</b>	<b>0,14</b>
	<b>Total de Hong Kong</b>	<b>1.339.259</b>	<b>0,83</b>	<b>PAÍSES BAJOS</b>			
<b>INDIA</b>				562	Akzo Nobel NV	61.473	0,04
53.600	Embassy Office Parks REIT	244.842	0,15	905	ASM International NV	354.721	0,22
10.964	HDFC Bank Limited	235.585	0,15	13.896	ING Groep NV	202.405	0,13
42.847	Hindalco Industries Limited	281.662	0,18	891	Koninklijke DSM NV	178.386	0,11
53.158	Petronet LNG Ltd	170.836	0,11	3.395	Philips NV	150.854	0,09
15.379	Tech Mahindra Limited	286.041	0,18	815	RELX plc	23.614	0,01
	<b>Total de India</b>	<b>1.218.966</b>	<b>0,77</b>		<b>Total de Países Bajos</b>	<b>971.453</b>	<b>0,60</b>
<b>INDONESIA</b>				<b>NORUEGA</b>			
1.025.681	Bank Rakyat Indonesia	275.908	0,17	3.003	Equinor ASA	76.595	0,05
211.900	Telkom Indonesia Persero Tbk PT	54.632	0,03		<b>Total de Noruega</b>	<b>76.595</b>	<b>0,05</b>
	<b>Total de Indonesia</b>	<b>330.540</b>	<b>0,20</b>				

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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Renta variable (continuación)</b>				<b>Renta variable (continuación)</b>					
<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>				<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>					
17.934	Comcast Corp.	1.003.049	0,62	4.556	Union Pacific Corp.	893.022	0,56		
18.865	Conocophillips	1.278.481	0,79	5.869	United Parcel Service Inc.	1.068.745	0,66		
333	Crown Castle International Corp.	57.716	0,04	5.247	Valero Energy Corp.	370.281	0,23		
6.264	DuPont de Nemours Inc.	425.889	0,27	16.489	Verizon Communications Inc.	890.571	0,56		
10.600	Ebay Inc.	738.503	0,47	4.247	Virtu Financial Inc.	103.754	0,06		
5.770	Edison International	320.062	0,20	5.775	Voya Financial Inc.	354.527	0,22		
4.558	Eli Lilly & Company	1.053.126	0,66	778	Wells Fargo & Company	36.107	0,02		
7.188	Equity Lifestyle Properties Inc.	561.383	0,35	9.232	Xcel Energy Inc.	577.000	0,36		
4.351	Fidelity National Information Services Inc.	529.430	0,33	<b>Total de Estados Unidos</b>			<b>43.086.905</b>	<b>26,86</b>	
1.491	General Motors Company	78.591	0,05	<b>Total de renta variable</b>			<b>75.484.246</b>	<b>46,98</b>	
81	Grainger (WWW) Inc.	31.838	0,02	<b>Bonos - convertibles</b>					
4.274	Home Depot Inc.	1.402.984	0,88	<b>CANADÁ</b>					
395	IBM Corp.	54.877	0,03	USD	175.000	Air Canada 4.00% 01/07/2025	251.892	0,16	
544	IntercontinentalExchange Inc.	62.462	0,04	<b>Total de Canadá</b>			<b>251.892</b>	<b>0,16</b>	
7.368	Johnson & Johnson	1.189.932	0,74	<b>Total de bonos - convertibles</b>				<b>251.892</b>	<b>0,16</b>
3.429	JPMorgan Chase & Company	561.293	0,35	<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>138.122.146</b>	<b>85,96</b>
3.323	KLA Corp.	1.111.577	0,69	<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente</b>					
10.556	Kontoor Brands Inc.	527.272	0,33	<b>Bonos</b>					
214	Marsh & McLennan Companies Inc.	32.406	0,02	<b>AUSTRALIA</b>					
1.227	Mastercard Inc. - A	426.603	0,27	USD	55.000	APT Pipelines Limited 4.25% 15/07/2027	62.456	0,04	
285	McDonald's Corp.	68.716	0,04	USD	137.000	Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	153.803	0,10	
10.561	Merck & Company Inc.	793.237	0,49	<b>Total de Australia</b>			<b>216.259</b>	<b>0,14</b>	
12.353	Metlife Inc.	762.551	0,47	<b>BERMUDAS</b>					
13.972	Microsoft Corp.	3.938.985	2,45	USD	100.000	Bacardi Limited 4.70% 15/05/2028	115.859	0,07	
7.514	Moelis & Company - A	464.891	0,29	<b>Total de Bermudas</b>			<b>115.859</b>	<b>0,07</b>	
9.375	Morgan Stanley	912.282	0,58	<b>PAÍSES BAJOS</b>					
10.491	NextEra Energy Inc.	823.754	0,51	USD	15.000	E.ON International Finance BV 6.65% 30/04/2038	21.873	0,01	
28.864	NortonLifeLock Inc.	730.259	0,45	<b>Total de Países Bajos</b>			<b>21.873</b>	<b>0,01</b>	
1.056	Organon & Company	34.626	0,02						
6.839	PepsiCo Inc.	1.028.654	0,65						
11.554	Philip Morris International Inc.	1.095.204	0,68						
8.752	Procter & Gamble Company	1.223.530	0,76						
7.532	Prologis Inc.	944.738	0,59						
301	Quest Diagnostics Inc.	43.738	0,03						
9.181	Raytheon Technologies Corp.	789.199	0,49						
1.209	SBA Communications	399.659	0,25						
491	Service Corp. International	29.588	0,02						
352	Stanley Works	61.710	0,04						
7.445	Starbucks Corp.	821.258	0,51						
1.023	State Street Corp.	86.669	0,05						
12.953	Store Capital Corp.	414.885	0,26						
3.816	Target Corp.	872.986	0,54						
4.774	Texas Instruments Inc.	917.611	0,57						
9.954	TJX Companies Inc.	656.765	0,41						
13.664	Truist Financial Corp.	801.393	0,50						

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			
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)</b>						
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda</b>						
<b>REINO UNIDO</b>				<b>ESTADOS UNIDOS</b>						
GBP	335.000	Bellis Acquisition Company 3.25% 16/02/2026	445.091	0,29	USD	180.000	Federal National Mortgage Association 5.63% 15/07/2037	270.944	0,17	
GBP	105.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	143.725	0,09	<b>Total de Estados Unidos</b>			<b>270.944</b>	<b>0,17</b>	
<b>Total del Reino Unido</b>				<b>588.816</b>	<b>0,38</b>	<b>Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda</b>				
<b>ESTADOS UNIDOS</b>				<b>ESTADOS UNIDOS</b>						
USD	147.000	Adient USA LLC 9.00% 15/04/2025	159.441	0,10	<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente</b>					
USD	48.000	Atlantic City Electric 2.30% 15/03/2031	48.506	0,03	<b>2.071.358</b>					
USD	109.000	Carrier Global Corp. 2.72% 15/02/2030	112.757	0,07	<b>Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario</b>					
USD	17.000	Commonwealth Edison Company 4.00% 01/03/2049	20.202	0,01	<b>Bonos</b>					
USD	25.000	Guardian Life Insurance Company of America 4.85% 24/01/2077	32.459	0,02	<b>CANADÁ</b>					
USD	47.000	Jersey Central Power & Light Company 2.75% 01/03/2032	48.176	0,03	CAD	50.000	Rogers Communications Inc. 3.65% 31/03/2027	42.255	0,03	
USD	35.000	Metropolitan Edison Company 4.30% 15/01/2029	39.270	0,02	<b>Total de Canadá</b>			<b>42.255</b>	<b>0,03</b>	
USD	156.000	Metropolitan Life Global Funding I 1.55% 07/01/2031	148.446	0,09	<b>PORTUGAL</b>					
USD	17.000	New York Life Insurance Company 4.45% 04/04/2069	21.522	0,01	EUR	100.000	Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2022	12.748	0,01	
USD	86.000	Northwestern Mutual Life Insurance Company 3.45% 30/03/2051	92.543	0,06	<b>Total de Portugal</b>			<b>12.748</b>	<b>0,01</b>	
USD	8.000	Northwestern Mutual Life Insurance Company 3.63% 30/09/2059	8.743	0,01	<b>REINO UNIDO</b>					
USD	18.000	Northwestern Mutual Life Insurance Company 3.85% 30/09/2047	20.505	0,01	GBP	100.000	Miller Homes Group Holdings plc 5.50% 15/10/2024	136.813	0,09	
USD	11.000	Teachers Insurance & Annuity Association America 4.90% 15/09/2044	14.261	0,01	GBP	166.000	Talktalk Telecom Group plc 3.88% 20/02/2025	219.905	0,14	
USD	75.000	Teachers Insurance & Annuity Association of America 4.27% 15/05/2047	90.776	0,06	GBP	145.000	Vmed O2 UK Financing I plc 4.50% 15/07/2031	200.217	0,12	
<b>Total de Estados Unidos</b>				<b>857.607</b>	<b>0,53</b>	<b>Total del Reino Unido</b>			<b>556.935</b>	<b>0,35</b>
<b>Total de bonos</b>				<b>1.800.414</b>	<b>1,13</b>	<b>Total de bonos</b>				
									<b>611.938</b>	<b>0,39</b>

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
<b>Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario</b> (continuación)			
<b>Renta variable</b>			
<b>AUSTRALIA</b>			
3,487	Transurban Group	35.667	0,02
	<b>Total de Australia</b>	<b>35.667</b>	<b>0,02</b>
	<b>Total de renta variable</b>	<b>35.667</b>	<b>0,02</b>
	<b>Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario</b>	<b>647.605</b>	<b>0,41</b>
<b>Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>			
<b>Fondos</b>			
<b>LUXEMBURGO</b>			
176.089	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income XUP*	2.493.980	1,55
430.169	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds XUP*	4.161.714	2,60
	<b>Total de Luxemburgo</b>	<b>6.655.694</b>	<b>4,15</b>
	<b>Total de fondos</b>	<b>6.655.694</b>	<b>4,15</b>
	<b>Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>	<b>6.655.694</b>	<b>4,15</b>
<b>Otros organismos de inversión colectiva</b>			
<b>Fondos</b>			
<b>REINO UNIDO</b>			
USD 1.425.274	Threadneedle Specialist Investment Funds ICVC - Emerging Market Local Fund**	4.309.031	2,68
	<b>Total del Reino Unido</b>	<b>4.309.031</b>	<b>2,68</b>
	<b>Total de fondos</b>	<b>4.309.031</b>	<b>2,68</b>
	<b>Total de otros organismos de inversión colectiva</b>	<b>4.309.031</b>	<b>2,68</b>
	<b>Valor total de las inversiones</b>	<b>151.805.834</b>	<b>94,50</b>
<b>(Coste total: 138.301.530 USD)</b>			

\* Consulte la nota 18.

\*\* Fondo de parte vinculada.

## Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities

### Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2021

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>			
<b>Renta variable</b>				<b>Renta variable (continuación)</b>			
<b>BERMUDAS</b>				<b>CHIPRE</b>			
16.000	Alibaba Health Information Technology Limited	23.020	0,27	1.530	Ozon Holdings plc	77.189	0,91
				1.707	Tcs Group Holding plc - Reg	156.703	1,85
	<b>Total de Bermudas</b>	<b>23.020</b>	<b>0,27</b>		<b>Total de Chipre</b>	<b>233.892</b>	<b>2,76</b>
<b>BRASIL</b>				<b>HONG KONG</b>			
22.123	Azul SA	147.827	1,75	9.600	AIA Group Limited	110.926	1,31
20.781	Banco BTG Pactual SA	95.955	1,14	7.976	Techtronic Industries Company	158.913	1,88
11.941	Localiza Rent a Car	119.368	1,41		<b>Total de Hong Kong</b>	<b>269.839</b>	<b>3,19</b>
23.634	Locaweb Servicios de Internet SA	99.239	1,17				
14.897	Mobly SA	18.591	0,22				
	<b>Total de Brasil</b>	<b>480.980</b>	<b>5,69</b>				
<b>ISLAS CAIMÁN</b>				<b>HUNGRÍA</b>			
2.448	Afya Limited	48.324	0,57	3.038	OTP Bank plc	178.390	2,11
1.762	Alibaba Group Holding Limited	260.864	3,10		<b>Total de Hungría</b>	<b>178.390</b>	<b>2,11</b>
1.821	Burning Rock Biotech Limited	32.559	0,39				
1.223	Dlocal Limited	66.727	0,79				
8.500	Everest Medicines Limited	53.721	0,64				
11.088	Kingdee International Software Group Company Limited	37.104	0,44				
851	NetEase Inc. - ADR	72.676	0,86				
2.820	Pageseguro Digital Limited	145.850	1,73				
503	Sea Limited	160.321	1,90				
4.200	Shenzhen International Group Holdings Limited	89.453	1,06				
8.100	Tencent Holdings Limited	480.091	5,69				
16.000	Wuxi Biologics Cayman Inc.	259.999	3,08				
2.287	Xp Inc. - A	91.869	1,09				
3.815	XPeng Inc.	135.585	1,60				
	<b>Total de Islas Caimán</b>	<b>1.935.143</b>	<b>22,94</b>				
<b>CHINA</b>				<b>INDIA</b>			
24.000	Country Garden Services Holdings	189.604	2,25	6.145	HDFC Bank Limited - ADR	449.137	5,32
3.100	Glodon Company Limited - A	32.004	0,38	12.604	ICICI Bank Limited - ADR	237.837	2,82
2.966	JD.com Inc. - ADR	214.264	2,54	9.500	Infosys Technologies Limited - ADR	211.376	2,50
12.500	Li Ning Company Limited	144.756	1,71		<b>Total de India</b>	<b>898.350</b>	<b>10,64</b>
4.940	WuXi AppTec Company Limited - H	115.557	1,37				
600	Zai Lab Limited	63.234	0,75				
	<b>Total de China</b>	<b>759.419</b>	<b>9,00</b>				
				<b>INDONESIA</b>			
				61.400	Bank Central Asia Tbk Pt	150.151	1,78
				880.136	Bank Rakyat Indonesia	236.756	2,80
					<b>Total de Indonesia</b>	<b>386.907</b>	<b>4,58</b>
				<b>KAZAJISTÁN</b>			
				272	Kaspi.KZ JSC	28.886	0,34
					<b>Total de Kazajistán</b>	<b>28.886</b>	<b>0,34</b>
				<b>LUXEMBURGO</b>			
				2.978	Allegro.eu SA	43.381	0,51
				246	Globant SA	69.128	0,82
					<b>Total de Luxemburgo</b>	<b>112.509</b>	<b>1,33</b>
				<b>REPÚBLICA DE COREA (SUR)</b>			
				798	Kakao Corp.	79.530	0,94
				104	KakaoBank Corp.	6.008	0,07
				439	Naver Corp.	143.861	1,70
				110	Samsung Biologics Company Limited	81.200	0,95

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities

### Estado de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>			
<b>Renta variable (continuación)</b>				<b>Fondos</b>			
<b>REPÚBLICA DE COREA (SUR) (continuación)</b>				<b>IRLANDA</b>			
1.265	Samsung Electro-Mechanics Company Limited	189.642	2,24	38.518	Ishares MSCI India UCITS ETF	302.405	3,58
8.458	Samsung Electronics Company Limited	529.336	6,27	<b>Total de Irlanda</b>			
203	Samsung Sdi Company Limited	123.102	1,46	<b>302.405 3,58</b>			
818	SK Hynix Inc.	71.160	0,84	<b>Total de fondos</b>			
<b>Total de República de Corea (Sur)</b>				<b>302.405 3,58</b>			
<b>1.223.839 14,47</b>				<b>Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>			
				<b>302.405 3,58</b>			
				<b>Valor total de las inversiones</b>			
				<b>8.471.445 100,28</b>			
				<b>(Coste total: 7.606.269 USD)</b>			
<b>SUDÁFRICA</b>							
1.297	Capitec Bank Holdings Limited	156.820	1,85				
<b>Total de Sudáfrica</b>							
<b>156.820 1,85</b>							
<b>TAIWÁN</b>							
8.000	Delta Electronics Inc.	72.360	0,86				
8.000	MediaTek Inc.	259.865	3,08				
6.194	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited - ADR	691.561	8,18				
<b>Total de Taiwán</b>							
<b>1.023.786 12,12</b>							
<b>TAILANDIA</b>							
58.000	Muangthai Capital plc	99.852	1,18				
<b>Total de Tailandia</b>							
<b>99.852 1,18</b>							
<b>ESTADOS UNIDOS</b>							
143	Mercadolibre Inc.	240.154	2,84				
<b>Total de Estados Unidos</b>							
<b>240.154 2,84</b>							
<b>ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)</b>							
13.050	Fix Price Group Limited	117.254	1,39				
<b>Total de Islas Vírgenes (Británicas)</b>							
<b>117.254 1,39</b>							
<b>Total de renta variable</b>							
<b>8.169.040 96,70</b>							
<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>							
<b>8.169.040 96,70</b>							

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.



## Threadneedle (Lux) - Global Focus

### Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2021

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>			
<b>Renta variable</b>				<b>Renta variable (continuación)</b>			
<b>ISLAS CAIMÁN</b>				<b>REPÚBLICA DE COREA (SUR)</b>			
67.504	Sea Limited	21.515.550	0,99	619.287	Samsung Electronics Company Limited	38.757.531	1,79
	<b>Total de Islas Caimán</b>	<b>21.515.550</b>	<b>0,99</b>		<b>Total de República de Corea (Sur)</b>	<b>38.757.531</b>	<b>1,79</b>
<b>DINAMARCA</b>				<b>SUIZA</b>			
214.485	Novo-Nordisk A/S	20.772.907	0,96	188.639	Nestle SA - Reg	22.789.967	1,05
1.924.033	Tryg A/S	43.751.899	2,02	152.676	TE Connectivity Limited	20.950.201	0,97
	<b>Total de Dinamarca</b>	<b>64.524.806</b>	<b>2,98</b>		<b>Total de Suiza</b>	<b>43.740.168</b>	<b>2,02</b>
<b>FRANCIA</b>				<b>TAIWÁN</b>			
51.831	L'Oreal SA	21.435.814	0,99	2.115.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	44.029.943	2,03
45.857	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	32.955.816	1,52		<b>Total de Taiwán</b>	<b>44.029.943</b>	<b>2,03</b>
	<b>Total de Francia</b>	<b>54.391.630</b>	<b>2,51</b>		<b>REINO UNIDO</b>		
<b>ALEMANIA</b>				<b>ESTADOS UNIDOS</b>			
308.976	Siemens Healthineers AG	20.117.369	0,93	316.825	Abbott Laboratories	37.426.537	1,73
464.420	Zalando SE	42.693.162	1,97	293.840	Activision Blizzard Inc.	22.740.278	1,05
	<b>Total de Alemania</b>	<b>62.810.531</b>	<b>2,90</b>	184.738	Adobe Systems Inc.	106.357.361	4,91
<b>HONG KONG</b>				<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>			
2.860.000	AIA Group Limited	33.046.720	1,52	48.280	Alphabet Inc. - A	129.077.546	5,95
872.000	Techtronic Industries Company	17.373.585	0,80	39.225	Amazon.com Inc.	128.855.695	5,94
	<b>Total de Hong Kong</b>	<b>50.420.305</b>	<b>2,32</b>	55.348	Ansys Inc.	18.843.227	0,87
<b>INDIA</b>				<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>			
840.407	Kotak Mahindra Bank Limited	22.706.197	1,05	84.287	Bill.com Holdings Inc.	22.500.415	1,04
	<b>Total de India</b>	<b>22.706.197</b>	<b>1,05</b>	135.804	Cadence Design Systems Inc.	20.566.158	0,95
<b>IRLANDA</b>				<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>			
125.926	Trane Technologies plc	21.741.124	1,00	574.817	Comcast Corp.	32.149.515	1,48
	<b>Total de Irlanda</b>	<b>21.741.124</b>	<b>1,00</b>	317.284	Edwards Lifesciences Corp.	35.919.722	1,66
<b>JAPÓN</b>				<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>			
397.800	Hoya Corp.	62.303.868	2,87	125.542	Facebook Inc. - A	42.607.699	1,97
80.212	Keyence Corp.	48.166.733	2,22	207.416	Intuit Inc.	111.903.006	5,16
838.800	Recruit Holdings Company Limited	51.361.692	2,37	136.602	Lam Research Corp.	77.747.028	3,58
	<b>Total de Japón</b>	<b>161.832.293</b>	<b>7,46</b>	338.696	Mastercard Inc. - A	117.757.825	5,43
				6.021	Mercadolibre Inc.	10.111.667	0,47
				605.582	Microsoft Corp.	170.725.678	7,87
				157.035	Nike Inc.	22.806.193	1,05
				182.935	Nvidia Corp.	37.896.815	1,75
				278.224	Paypal Holdings Inc.	72.396.667	3,34
				76.948	S&P Global Inc.	32.694.435	1,51
				63.058	Square Inc. - A	15.123.831	0,70

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## Threadneedle (Lux) - Global Focus

### Estado de la Cartera

(continuación)

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

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

##### Renta variable (continuación)

##### ESTADOS UNIDOS (continuación)

86.363	Stryker Corp.	22.775.650	1,05
148.575	Thermo Fisher Scientific Inc.	84.885.354	3,92
181.294	TransUnion	20.361.129	0,94
112.452	Union Pacific Corp.	22.041.717	1,02
330.444	Walt Disney Company	55.901.211	2,58
39.507	Zebra Technologies Corp.	20.362.698	0,94
116.028	Zoetis Inc.	22.525.676	1,03

**Total de Estados Unidos** **1.515.060.733** **69,89**

**Total de renta variable** **2.141.791.803** **98,80**

**Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa** **2.141.791.803** **98,80**

#### Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios

##### Fondos

##### IRLANDA

25.009.773	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	25.009.773	1,15
	<b>Total de Irlanda</b>	<b>25.009.773</b>	<b>1,15</b>

**Total de fondos** **25.009.773** **1,15**

**Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios** **25.009.773** **1,15**

**Valor total de las inversiones** **2.166.801.576** **99,95**

(Coste total: 1.632.151.699 USD)

## Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities

## Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2021

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>			
<b>Renta variable</b>				<b>Renta variable (continuación)</b>			
<b>BERMUDAS</b>				<b>CHINA (continuación)</b>			
290.000	Alibaba Health Information Technology Limited	417.232	0,24	45.200	Glodon Company Limited - A	466.638	0,27
				57.794	JD.com Inc. - ADR	4.175.039	2,45
	<b>Total de Bermudas</b>	<b>417.232</b>	<b>0,24</b>	4.008	Kweichow Moutai Company Limited - A	1.136.451	0,67
<b>BRASIL</b>				285.000	Li Ning Company Limited	3.300.440	1,94
398.107	Azul SA	2.660.180	1,56	75.400	Midea Group Company Limited - A	813.116	0,48
389.456	Banco BTG Pactual SA	1.798.289	1,06	15.100	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Company Limited	901.744	0,53
170.661	Localiza Rent a Car	1.706.012	1,00	31.771	Skshu Paint Company Limited - A	492.269	0,29
498.856	Locaweb Servicios de Internet SA	2.094.699	1,23	637.400	Songcheng Performance Development Company Limited	1.390.550	0,82
308.417	Magazine Luiza SA	811.667	0,48	97.732	WuXi AppTec Company Limited - H	2.286.167	1,35
45.572	Notre Dame Intermedica Participacoes	624.001	0,37	7.286	Zai Lab Limited	767.872	0,45
	<b>Total de Brasil</b>	<b>9.694.848</b>	<b>5,70</b>		<b>Total de China</b>	<b>21.967.859</b>	<b>12,90</b>
<b>CANADÁ</b>				<b>CHIPRE</b>			
36.401	Parex Resources Inc.	662.019	0,39	39.199	Ozon Holdings plc	1.977.590	1,16
	<b>Total de Canadá</b>	<b>662.019</b>	<b>0,39</b>	27.245	Tcs Group Holding plc - Reg	2.501.091	1,47
<b>ISLAS CAIMÁN</b>				<b>HONG KONG</b>			
60.276	Afya Limited	1.189.848	0,70	196.800	AIA Group Limited	2.273.984	1,34
35.427	Alibaba Group Holding Limited	5.244.967	3,08	168.000	Techtronic Industries Company	3.347.204	1,96
2.181	Beigene Limited - ADR	791.703	0,46		<b>Total de Hong Kong</b>	<b>5.621.188</b>	<b>3,30</b>
18.940	Bilibili Inc. - Z	1.233.528	0,73	<b>HUNGRÍA</b>			
23.272	Burning Rock Biotech Limited	416.103	0,24	42.833	OTP Bank plc	2.515.128	1,48
24.575	Dlocal Limited	1.340.812	0,79		<b>Total de Hungría</b>	<b>2.515.128</b>	<b>1,48</b>
272.000	Kingdee International Software Group Company Limited	910.202	0,53	<b>INDIA</b>			
16.648	NetEase Inc. - ADR	1.421.739	0,84	27.285	Apollo Hospitals Enterprise Limited	1.647.362	0,97
47.746	Pagseguro Digital Limited	2.469.423	1,45	23.995	Avenue Supermarts Limited	1.373.922	0,81
10.272	Sea Limited	3.273.995	1,92	17.054	Bajaj Finance Limited	1.761.757	1,03
103.400	Shenzhou International Group Holdings Limited	2.202.248	1,29	39.508	Balkrishna Industries Limited	1.348.540	0,79
144.800	Tencent Holdings Limited	8.582.372	5,03	72.325	Cholamandalam Investment and Finance Company Limited	549.784	0,32
287.500	Wuxi Biologics Cayman Inc.	4.671.858	2,73	14.763	Dixon Technologies India Limited	917.248	0,54
38.726	Xp Inc. - A	1.555.623	0,91	23.437	Eicher Motors Limited	880.987	0,52
44.865	XPeng Inc.	1.594.502	0,93	30.558	HDFC Bank Limited - ADR	2.233.484	1,31
	<b>Total de Islas Caimán</b>	<b>36.898.923</b>	<b>21,63</b>	114.605	HDFC Standard Life Insurance	1.115.356	0,65
<b>CHINA</b>				12.159	Jubilant Foodworks Limited	661.924	0,39
24.903	Beijing Kingsoft Office Software Inc.	1.093.203	0,64				
17.900	China International Travel Service Corp. Limited - A	721.105	0,42				
559.895	Country Garden Services Holdings	4.423.265	2,59				

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
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>			
<b>Renta variable (continuación)</b>				<b>Renta variable (continuación)</b>			
<b>INDIA (continuación)</b>				<b>REPÚBLICA DE COREA (SUR) (continuación)</b>			
61.838	Kotak Mahindra Bank Limited	1.670.745	0,98	134.960	Samsung Electronics Company Limited	8.446.353	4,96
127.159	Reliance Industries Limited	4.315.692	2,53	2.666	Samsung Sdi Company Limited	1.616.704	0,95
	<b>Total de India</b>	<b>18.476.801</b>	<b>10,84</b>	16.955	SK Hynix Inc.	1.474.962	0,87
<b>INDONESIA</b>				<b>Total de República de Corea (Sur)</b>			
456.500	ACE Hardware Indonesia	40.507	0,02			<b>19.679.209</b>	<b>11,56</b>
1.201.300	Bank Central Asia Tbk Pt	2.937.719	1,72	<b>FEDERACIÓN RUSA</b>			
12.279.266	Bank Rakyat Indonesia	3.303.116	1,94	31.672	Lukoil PJSC - ADR	3.034.811	1,78
4.509.800	Bank Tabungan Pensiunan Nasional Syariah Tbk Pt	1.093.396	0,64	206.183	Sberbank - ADR	3.880.364	2,28
	<b>Total de Indonesia</b>	<b>7.374.738</b>	<b>4,32</b>		<b>Total de la Federación Rusa</b>	<b>6.915.175</b>	<b>4,06</b>
<b>KAZAJISTÁN</b>				<b>SUDÁFRICA</b>			
6.794	Kaspi.KZ JSC	721.523	0,42	10.152	Capitec Bank Holdings Limited	1.227.480	0,72
	<b>Total de Kazajistán</b>	<b>721.523</b>	<b>0,42</b>		<b>Total de Sudáfrica</b>	<b>1.227.480</b>	<b>0,72</b>
<b>LUXEMBURGO</b>				<b>TAIWÁN</b>			
45.562	Allegro.eu SA	663.711	0,39	137.000	MediaTek Inc.	4.450.194	2,61
4.632	Globant SA	1.301.638	0,76	125.459	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited - ADR	14.007.497	8,21
	<b>Total de Luxemburgo</b>	<b>1.965.349</b>	<b>1,15</b>		<b>Total de Taiwán</b>	<b>18.457.691</b>	<b>10,82</b>
<b>PAÍSES BAJOS</b>				<b>TAILANDIA</b>			
33.179	Yandex NV - A	2.644.035	1,55	1.015.300	Muangthai Capital plc	1.747.919	1,03
	<b>Total de Países Bajos</b>	<b>2.644.035</b>	<b>1,55</b>		<b>Total de Tailandia</b>	<b>1.747.919</b>	<b>1,03</b>
<b>FILIPINAS</b>				<b>ESTADOS UNIDOS</b>			
2.095.300	Ayala Land Inc.	1.376.055	0,81	28.723	Coupang Inc.	799.936	0,47
	<b>Total de Filipinas</b>	<b>1.376.055</b>	<b>0,81</b>	1.882	Mercadolibre Inc.	3.160.631	1,85
<b>POLONIA</b>					<b>Total de Estados Unidos</b>	<b>3.960.567</b>	<b>2,32</b>
19.603	Dino Polska SA	1.639.816	0,96	<b>ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)</b>			
	<b>Total de Polonia</b>	<b>1.639.816</b>	<b>0,96</b>	223.974	Fix Price Group Limited	2.012.406	1,18
<b>REPÚBLICA DE COREA (SUR)</b>					<b>Total de Islas Vírgenes (Británicas)</b>	<b>2.012.406</b>	<b>1,18</b>
3.051	Ecopro Bm Company Limited	1.203.386	0,71	<b>Total de renta variable</b>			
16.280	Kakao Corp.	1.622.491	0,95			<b>170.454.642</b>	<b>100,01</b>
2.156	KakaoBank Corp.	124.552	0,07	<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>			
5.172	Naver Corp.	1.694.869	0,99			<b>170.454.642</b>	<b>100,01</b>
1.838	Samsung Biologics Company Limited	1.356.759	0,80				
14.269	Samsung Electro-Mechanics Company Limited	2.139.133	1,26				

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
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente</b>			
<b>Renta variable</b>			
<b>FEDERACIÓN RUSA</b>			
597.602	Detsky Mir PJSC	1.070.807	0,63
	<b>Total de la Federación Rusa</b>	<b>1.070.807</b>	<b>0,63</b>
	<b>Total de renta variable</b>	<b>1.070.807</b>	<b>0,63</b>
	<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente</b>	<b>1.070.807</b>	<b>0,63</b>
	<b>Valor total de las inversiones</b>	<b>171.525.449</b>	<b>100,64</b>
<b>(Coste total: 122.016.065 USD)</b>			

## Threadneedle (Lux) - Global Equity Income

### Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2021

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>			
<b>Renta variable</b>				<b>Renta variable (continuación)</b>			
<b>AUSTRALIA</b>				<b>INDONESIA</b>			
132.907	Carsales.Com Limited	2.432.776	1,13	13.999.625	Bank Rakyat Indonesia	3.765.892	1,75
	<b>Total de Australia</b>	<b>2.432.776</b>	<b>1,13</b>	10.957.800	Telkom Indonesia Persero Tbk PT	2.825.143	1,32
<b>CANADÁ</b>				<b>Total de Indonesia</b>			
26.321	Canadian National Railway Company	3.049.607	1,41			<b>6.591.035</b>	<b>3,07</b>
176.297	Manulife Financial Corp.	3.392.760	1,57	<b>IRLANDA</b>			
26.850	Ritchie Bros Auctioneers Inc.	1.655.571	0,77	57.606	CRH plc	2.707.886	1,26
142.786	Suncor Energy Inc.	2.959.749	1,38	35.439	Experian plc	1.485.610	0,69
	<b>Total de Canadá</b>	<b>11.057.687</b>	<b>5,13</b>	9.006	Linde plc	2.642.180	1,23
<b>ISLAS CAIMÁN</b>				40.562	Medtronic Inc.	5.084.447	2,37
29.923	NetEase Inc. - ADR	2.555.424	1,19	<b>Total de Irlanda</b>			
	<b>Total de Islas Caimán</b>	<b>2.555.424</b>	<b>1,19</b>			<b>11.920.123</b>	<b>5,55</b>
<b>CHINA</b>				<b>JAPÓN</b>			
338.292	Ping An Insurance Group Company of China Limited	2.314.049	1,08	8.600	Disco Corp.	2.416.401	1,12
	<b>Total de China</b>	<b>2.314.049</b>	<b>1,08</b>	38.100	Rohm Company Limited	3.633.287	1,69
<b>DINAMARCA</b>				<b>PAÍSES BAJOS</b>			
96.279	Tryg A/S	2.189.354	1,02	27.807	Akzo Nobel NV	3.041.577	1,42
	<b>Total de Dinamarca</b>	<b>2.189.354</b>	<b>1,02</b>	47.407	Philips NV	2.106.489	0,98
<b>FRANCIA</b>				42.196	RELX plc	1.222.576	0,57
68.884	BNP Paribas	4.425.948	2,06	<b>Total de Países Bajos</b>			
57.689	TotalEnergies SE	2.763.603	1,29			<b>6.370.642</b>	<b>2,97</b>
38.019	Vinci SA	3.972.200	1,85	<b>NORUEGA</b>			
	<b>Total de Francia</b>	<b>11.161.751</b>	<b>5,20</b>	136.485	Equinor ASA	3.481.202	1,61
<b>ALEMANIA</b>				<b>REPÚBLICA DE COREA (SUR)</b>			
180.776	Deutsche Telekom AG - Reg	3.644.643	1,69	93.024	Samsung Electronics Company Limited	5.821.824	2,70
199.339	E.ON AG	2.441.461	1,14	<b>Total de República de Corea (Sur)</b>			
64.619	Evonik Industries AG	2.042.255	0,95			<b>5.821.824</b>	<b>2,70</b>
10.901	Muenchener Rueckversicherungs AG - Reg	2.992.927	1,39	<b>SINGAPUR</b>			
16.425	Siemens AG - Reg	2.701.554	1,26	123.900	DBS Group Holdings Limited	2.767.124	1,29
	<b>Total de Alemania</b>	<b>13.822.840</b>	<b>6,43</b>	<b>Total de Singapur</b>			
						<b>2.767.124</b>	<b>1,29</b>
				<b>ESPAÑA</b>			
				109.128	Inditex SA	4.024.400	1,88
				<b>Total de España</b>			
						<b>4.024.400</b>	<b>1,88</b>

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
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>			
<b>Renta variable (continuación)</b>				<b>Renta variable (continuación)</b>			
<b>SUECIA</b>				<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>			
48.951	Sandvik AB	1.125.783	0,52	10.716	Marsh & McLennan Companies Inc.	1.622.724	0,76
	<b>Total de Suecia</b>	<b>1.125.783</b>	<b>0,52</b>	14.122	McDonald's Corp.	3.404.955	1,58
<b>SUIZA</b>				18.587	Microsoft Corp.	5.240.047	2,44
36.584	Novartis AG - Reg	3.013.078	1,40	32.024	NextEra Energy Inc.	2.514.524	1,17
	<b>Total de Suiza</b>	<b>3.013.078</b>	<b>1,40</b>	26.151	PepsiCo Inc.	3.933.373	1,83
<b>TAIWÁN</b>				26.366	Procter & Gamble Company	3.685.967	1,72
101.000	MediaTek Inc.	3.280.800	1,53	16.155	Quest Diagnostics Inc.	2.347.483	1,09
141.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	2.935.330	1,37	25.742	Service Corp. International	1.551.213	0,72
	<b>Total de Taiwán</b>	<b>6.216.130</b>	<b>2,90</b>	17.472	Stanley Works	3.063.017	1,43
<b>REINO UNIDO</b>				50.695	State Street Corp.	4.294.880	2,00
136.238	3i Group plc	2.354.071	1,10	27.749	Truist Financial Corp.	1.627.479	0,76
66.654	Anglo American plc	2.356.917	1,09	14.099	United Parcel Service Inc.	2.567.428	1,20
1.601.824	BT Group plc	3.451.391	1,61	42.470	Valero Energy Corp.	2.997.108	1,40
56.369	Diageo plc	2.740.745	1,28	39.736	Wells Fargo & Company	1.844.148	0,86
154.460	Glaxosmithkline plc	2.923.224	1,36	57.199	Xcel Energy Inc.	3.574.938	1,66
44.246	Reckitt Benckiser Group plc	3.478.125	1,62		<b>Total de Estados Unidos</b>	<b>89.359.776</b>	<b>41,61</b>
18.735	Rio Tinto plc	1.241.216	0,58		<b>Total de renta variable</b>	<b>210.820.375</b>	<b>98,13</b>
	<b>Total del Reino Unido</b>	<b>18.545.689</b>	<b>8,64</b>		<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>	<b>210.820.375</b>	<b>98,13</b>
<b>ESTADOS UNIDOS</b>					<b>Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>		
16.694	Allstate Corp.	2.125.313	0,99		<b>Fondos</b>		
38.433	American Electric Power Company Inc.	3.119.991	1,45		<b>IRLANDA</b>		
9.923	American Tower Corp.	2.633.663	1,23	54.122	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	54.122	0,03
16.075	Analog Devices Inc.	2.692.241	1,25		<b>Total de Irlanda</b>	<b>54.122</b>	<b>0,03</b>
8.817	Anthem Inc.	3.286.978	1,53		<b>Total de fondos</b>	<b>54.122</b>	<b>0,03</b>
8.161	Automatic Data Processing Inc.	1.631.547	0,76		<b>Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>	<b>54.122</b>	<b>0,03</b>
73.474	Bristol-Myers Squibb Company	4.347.456	2,03		<b>Valor total de las inversiones</b>	<b>210.874.497</b>	<b>98,16</b>
15.930	Citrix Systems Inc.	1.710.404	0,80		<b>(Coste total: 192.712.542 USD)</b>		
63.052	Coca Cola Company	3.308.338	1,54				
16.486	Crown Castle International Corp.	2.857.354	1,33				
38.549	Ebay Inc.	2.685.709	1,25				
26.359	Fidelity National Information Services Inc.	3.207.363	1,49				
73.665	General Motors Company	3.882.882	1,81				
3.971	Grainger (WWW) Inc.	1.560.841	0,73				
20.586	IBM Corp.	2.860.013	1,33				
27.699	IntercontinentalExchange Inc.	3.180.399	1,47				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## Threadneedle (Lux) - Global Select

### Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2021

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>			
<b>Renta variable</b>				<b>Renta variable (continuación)</b>			
<b>ISLAS CAIMÁN</b>				<b>JAPÓN</b>			
20.737	Sea Limited	6.609.504	1,05	15.900	Keyence Corp.	9.547.835	1,53
	<b>Total de Islas Caimán</b>	<b>6.609.504</b>	<b>1,05</b>	77.800	Rohm Company Limited	7.419.152	1,18
<b>DINAMARCA</b>				206.700	Sekisui Chemical Company Limited	3.569.893	0,57
92.569	Novo-Nordisk A/S	8.965.323	1,43	60.700	Sony Corp.	6.775.876	1,08
41.009	Orsted AS	5.425.174	0,86	135.100	Yaskawa Electric Corp.	6.538.561	1,04
232.933	Tryg A/S	5.296.822	0,84		<b>Total de Japón</b>	<b>33.851.317</b>	<b>5,40</b>
	<b>Total de Dinamarca</b>	<b>19.687.319</b>	<b>3,13</b>	<b>PAÍSES BAJOS</b>			
<b>FINLANDIA</b>				26.869	Airbus SE	3.584.194	0,57
132.229	Upm-Kymmene Oyj	4.706.209	0,75		<b>Total de Países Bajos</b>	<b>3.584.194</b>	<b>0,57</b>
	<b>Total de Finlandia</b>	<b>4.706.209</b>	<b>0,75</b>	<b>NORUEGA</b>			
<b>FRANCIA</b>				198.569	Equinor ASA	5.064.724	0,81
43.011	Essilor International SA	8.249.778	1,31		<b>Total de Noruega</b>	<b>5.064.724</b>	<b>0,81</b>
63.702	Schneider Electric SE	10.623.768	1,69	<b>REPÚBLICA DE COREA (SUR)</b>			
	<b>Total de Francia</b>	<b>18.873.546</b>	<b>3,00</b>	238.972	Samsung Electronics Company Limited	14.955.852	2,38
<b>ALEMANIA</b>				7.831	Samsung Sdi Company Limited	4.748.841	0,76
22.102	Adidas AG	6.962.188	1,11		<b>Total de República de Corea (Sur)</b>	<b>19.704.693</b>	<b>3,14</b>
	<b>Total de Alemania</b>	<b>6.962.188</b>	<b>1,11</b>	<b>SUIZA</b>			
<b>HONG KONG</b>				75.364	Nestle SA - Reg	9.104.921	1,45
770.600	AIA Group Limited	8.904.127	1,42	21.558	Roche Holding AG	7.902.407	1,26
	<b>Total de Hong Kong</b>	<b>8.904.127</b>	<b>1,42</b>	63.075	TE Connectivity Limited	8.655.152	1,38
<b>INDIA</b>					<b>Total de Suiza</b>	<b>25.662.480</b>	<b>4,09</b>
407.933	HDFC Bank Limited	8.765.324	1,40	<b>TAIWÁN</b>			
	<b>Total de India</b>	<b>8.765.324</b>	<b>1,40</b>	445.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	9.263.983	1,48
<b>INDONESIA</b>					<b>Total de Taiwán</b>	<b>9.263.983</b>	<b>1,48</b>
31.168.474	Bank Rakyat Indonesia	8.384.304	1,34	<b>REINO UNIDO</b>			
	<b>Total de Indonesia</b>	<b>8.384.304</b>	<b>1,34</b>	173.993	Diageo plc	8.459.801	1,35
<b>IRLANDA</b>				255.122	SSE plc	5.404.142	0,86
168.656	CRH plc	7.928.015	1,26		<b>Total del Reino Unido</b>	<b>13.863.943</b>	<b>2,21</b>
98.953	Medtronic Inc.	12.403.758	1,98				
39.624	Trane Technologies plc	6.841.084	1,09				
	<b>Total de Irlanda</b>	<b>27.172.857</b>	<b>4,33</b>				

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
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>			
<b>Renta variable (continuación)</b>				<b>Fondos</b>			
<b>ESTADOS UNIDOS</b>				<b>IRLANDA</b>			
47.449	Abbott Laboratories	5.605.150	0,89	5.100.186	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	5.100.186	0,81
93.219	Activision Blizzard Inc.	7.214.218	1,15				
25.001	Adobe Systems Inc.	14.393.576	2,30		<b>Total de Irlanda</b>	<b>5.100.186</b>	<b>0,81</b>
13.024	Alphabet Inc. - A	34.819.924	5,55				
9.441	Amazon.com Inc.	31.014.062	4,95		<b>Total de fondos</b>	<b>5.100.186</b>	<b>0,81</b>
23.252	American Tower Corp.	6.171.313	0,98				
32.815	Autodesk Inc.	9.357.854	1,49		<b>Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>	<b>5.100.186</b>	<b>0,81</b>
129.395	Centene Corp.	8.062.602	1,28				
186.790	Comcast Corp.	10.447.165	1,66		<b>Valor total de las inversiones</b>	<b>617.685.226</b>	<b>98,44</b>
16.499	Cooper Companies Inc.	6.819.202	1,09				
21.226	Deere & Company	7.112.196	1,13		<b>(Coste total: 454.483.914 USD)</b>		
30.517	Ecolab Inc.	6.366.457	1,01				
32.930	Edwards Lifesciences Corp.	3.728.005	0,59				
50.871	Electronic Arts Inc.	7.236.400	1,15				
7.822	Equinix Inc.	6.180.397	0,99				
44.982	Facebook Inc. - A	15.266.441	2,43				
64.063	Fidelity National Information Services Inc.	7.795.186	1,24				
152.784	General Motors Company	8.053.245	1,28				
19.657	Intuit Inc.	10.605.148	1,69				
80.204	JPMorgan Chase & Company	13.128.593	2,09				
17.271	Lam Research Corp.	9.829.790	1,57				
48.045	Mastercard Inc. - A	16.704.285	2,67				
3.650	Mercadolibre Inc.	6.129.810	0,98				
121.299	Microsoft Corp.	34.196.613	5,46				
116.753	NextEra Energy Inc.	9.167.445	1,47				
75.068	Nvidia Corp.	15.551.087	2,48				
46.565	Paypal Holdings Inc.	12.116.679	1,93				
71.026	Pinterest Inc.	3.618.775	0,58				
15.133	S&P Global Inc.	6.429.860	1,02				
30.965	Stryker Corp.	8.166.090	1,30				
9.714	Thermo Fisher Scientific Inc.	5.549.900	0,88				
88.426	T-Mobile USA Inc.	11.297.306	1,80				
47.167	TransUnion	5.297.326	0,84				
153.711	Uber Technologies Inc.	6.886.253	1,10				
46.541	Union Pacific Corp.	9.122.501	1,45				
71.428	Walt Disney Company	12.083.474	1,93				
	<b>Total de Estados Unidos</b>	<b>391.524.328</b>	<b>62,40</b>				
	<b>Total de renta variable</b>	<b>612.585.040</b>	<b>97,63</b>				
	<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>	<b>612.585.040</b>	<b>97,63</b>				

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
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>			
<b>Renta variable (continuación)</b>				<b>Renta variable (continuación)</b>			
<b>REINO UNIDO (continuación)</b>				<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>			
247.509	Games Workshop Group plc	29.573.277	1,46	211.522	TechTarget Inc.	15.042.618	0,74
319.994	Genus plc	20.364.192	1,01	551.723	Terminix Global Holdings Inc.	19.837.178	0,98
306.160	Keywords Studios plc	10.372.366	0,51	359.108	Triumph Bancorp Inc.	31.025.915	1,54
328.494	Renishaw plc	18.145.802	0,90	66.708	Watsco Inc.	15.231.262	0,75
1.406.590	RWS Holdings plc	10.252.425	0,51	69.909	WD-40 Company	13.963.101	0,69
1.816.644	Watches of Switzerland Group plc	19.993.968	0,99	1.313.258	WillScot Mobile Mini Holdings Corp.	35.943.348	1,78
	<b>Total del Reino Unido</b>	<b>150.697.332</b>	<b>7,46</b>	292.106	Workiva Inc.	35.528.073	1,76
				150.876	XPEL Inc.	9.875.709	0,49
					<b>Total de Estados Unidos</b>	<b>1.019.382.837</b>	<b>50,50</b>
<b>ESTADOS UNIDOS</b>				<b>Total de renta variable</b>			
376.572	Aaon Inc.	21.230.609	1,05			<b>1.947.864.334</b>	<b>96,48</b>
314.513	Advanced Drainage Systems	29.354.909	1,45	<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>			
522.553	Altair Engineering Inc.	31.084.002	1,54			<b>1.947.864.334</b>	<b>96,48</b>
426.637	Armstrong World Industries Inc.	35.144.773	1,74	<b>Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>			
323.506	Aspen Technology Inc.	34.278.042	1,70	<b>Fondos</b>			
202.116	Blackline Inc.	20.589.167	1,02	<b>IRLANDA</b>			
184.610	Cardlytics Inc.	13.370.864	0,66	62.817.797	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	54.202.336	2,68
461.450	Casella Waste Systems Inc. - A	30.236.432	1,50		<b>Total de Irlanda</b>	<b>54.202.336</b>	<b>2,68</b>
754.842	Certara Inc.	21.558.540	1,07	<b>Total de fondos</b>			
268.884	Conmed Corp.	30.353.418	1,50			<b>54.202.336</b>	<b>2,68</b>
308.533	Dermtech Inc.	8.548.250	0,42	<b>Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>			
399.324	Duck Creek Technologies Inc.	15.243.189	0,76			<b>54.202.336</b>	<b>2,68</b>
528.628	Envestnet Inc.	36.599.603	1,81	<b>Valor total de las inversiones</b>			
739.709	Evo Payments Inc.	15.113.947	0,75			<b>2.002.066.670</b>	<b>99,16</b>
331.053	Exponent Inc.	32.321.193	1,60	<b>(Coste total: 1.684.584.329 EUR)</b>			
682.035	Flywire Corp.	25.799.572	1,28				
176.962	Freshpet Inc.	21.787.573	1,08				
169.311	Goosehead Insurance Inc.	22.248.045	1,10				
431.914	Grocery Outlet Holding Corp.	8.038.643	0,40				
470.738	Hamilton Lane Inc.	34.451.871	1,71				
1.353.028	Hayward Holdings Inc.	25.964.315	1,29				
372.071	Inter Parfums Inc.	24.004.270	1,19				
794.158	Leslie's Inc.	14.074.814	0,70				
690.040	Live Oak Bancshares Inc.	37.885.366	1,87				
541.857	Matterport Inc.	8.841.206	0,44				
260.568	MSA Safety Inc.	32.757.891	1,62				
125.108	Novanta Inc.	16.678.188	0,83				
221.097	Power Integrations Inc.	18.884.673	0,94				
806.560	Ranpak Holdings Corp.	18.665.119	0,93				
158.039	Schrodinger Inc./United States	7.456.381	0,37				
200.147	Service Corp. International	10.406.711	0,52				
471.930	Shift4 Payments Inc.	31.566.516	1,56				
450.396	Simpson Manufacturing Company Inc.	41.571.129	2,07				
98.781	SiteOne Landscape Supply Inc.	17.001.463	0,84				
109.748	SiTime Corp.	19.334.095	0,95				
219.065	Sps Commerce Inc.	30.490.854	1,51				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## Threadneedle (Lux) - American

## Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2021

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>			
<b>Renta variable</b>				<b>Renta variable (continuación)</b>			
<b>SUIZA</b>				<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>			
221.537	TE Connectivity Limited	30.399.307	2,60	220.577	Take-Two Interactive Software Inc.	33.984.297	2,90
	<b>Total de Suiza</b>	<b>30.399.307</b>	<b>2,60</b>	178.042	Target Corp.	40.730.669	3,48
<b>ESTADOS UNIDOS</b>				78.256	Teradata Corp.	4.487.982	0,38
45.066	Adobe Systems Inc.	25.945.398	2,22	208.958	TJX Companies Inc.	13.787.049	1,18
87.759	Agco Corp.	10.753.110	0,92	81.927	TransUnion	9.201.221	0,79
57.215	Albemarle Corp.	12.528.368	1,07	102.416	Union Pacific Corp.	20.074.560	1,72
132.042	Allstate Corp.	16.810.267	1,44	154.366	United Parcel Service Inc.	28.110.049	2,40
19.667	Alphabet Inc. - A	52.580.118	4,49	86.930	Vertex Pharmaceuticals Inc.	15.768.233	1,35
14.083	Amazon.com Inc.	46.263.218	3,95	320.297	VF Corp.	21.456.696	1,83
162.380	American Electric Power Company Inc.	13.182.009	1,12	487.019	Virtu Financial Inc.	11.897.874	1,02
68.486	Aspen Technology Inc.	8.410.081	0,72	413.543	Voya Financial Inc.	25.387.405	2,17
47.128	Bill.com Holdings Inc.	12.580.820	1,07	74.428	Zoetis Inc.	14.449.452	1,23
442.306	Bristol-Myers Squibb Company	26.171.246	2,24		<b>Total de Estados Unidos</b>	<b>1.124.334.873</b>	<b>96,05</b>
67.654	Broadcom Inc.	32.807.454	2,80		<b>Total de renta variable</b>	<b>1.154.734.180</b>	<b>98,65</b>
77.298	Caterpillar Inc.	14.838.897	1,27		<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>	<b>1.154.734.180</b>	<b>98,65</b>
434.353	Centene Corp.	27.064.535	2,31		<b>Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>		
802.217	Cisco Systems Inc.	43.664.671	3,73		<b>Fondos</b>		
790.464	Coca Cola Company	41.475.646	3,54		<b>IRLANDA</b>		
361.105	Comcast Corp.	20.196.603	1,73	13.011.880	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	13.011.880	1,11
335.404	CVS Health Corp.	28.462.383	2,43		<b>Total de Irlanda</b>	<b>13.011.880</b>	<b>1,11</b>
162.091	DuPont de Nemours Inc.	11.020.567	0,94		<b>Total de fondos</b>	<b>13.011.880</b>	<b>1,11</b>
70.423	Eli Lilly & Company	16.271.234	1,39		<b>Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>	<b>13.011.880</b>	<b>1,11</b>
261.827	Endeavor Group Holdings Inc.	7.506.580	0,64		<b>Valor total de las inversiones</b>	<b>1.167.746.060</b>	<b>99,76</b>
26.247	Enphase Energy Inc.	3.936.263	0,34		<b>(Coste total: 945.647.348 USD)</b>		
105.438	Fidelity National Information Services Inc.	12.829.696	1,10				
107.569	FMC Corp.	9.849.018	0,84				
432.049	General Motors Company	22.773.303	1,95				
177.693	Hilton Worldwide Holdings Inc.	23.475.022	2,01				
386.924	Howmet Aerospace Inc.	12.072.029	1,03				
251.795	Ingersoll Rand Inc.	12.692.986	1,08				
223.016	IntercontinentalExchange Inc.	25.606.697	2,19				
35.318	Lam Research Corp.	20.101.240	1,72				
126.141	Mastercard Inc. - A	43.856.703	3,74				
83.698	Microchip Technology Inc.	12.846.806	1,10				
149.976	Microsoft Corp.	42.281.233	3,61				
105.258	Mirati Therapeutics Inc.	18.621.193	1,59				
593.666	Morgan Stanley	57.769.639	4,93				
130.895	NextEra Energy Inc.	10.277.875	0,88				
64.652	Nvidia Corp.	13.393.308	1,14				
264.496	Renewable Energy Group Inc.	13.277.699	1,13				
90.337	Republic Services Inc.	10.845.860	0,93				
46.198	Salesforce.com Inc.	12.529.822	1,07				
277.673	State Street Corp.	23.524.457	2,01				
21.496	Svb Financial Group	13.905.332	1,19				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## Threadneedle (Lux) - American Select

### Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2021

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>			
<b>Renta variable</b>				<b>Renta variable (continuación)</b>			
<b>SUIZA</b>				<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>			
68.003	TE Connectivity Limited	9.331.372	2,06	58.552	Zoetis Inc.	11.367.286	2,51
<b>Total de Suiza</b>		<b>9.331.372</b>	<b>2,06</b>	<b>Total de Estados Unidos</b>		<b>433.838.742</b>	<b>95,93</b>
<b>ESTADOS UNIDOS</b>				<b>Total de renta variable</b>			
38.987	Adobe Systems Inc.	22.445.595	4,96	<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>			
36.348	Agco Corp.	4.453.720	0,98	<b>443.170.114 97,99</b>			
9.186	Alphabet Inc. - A	24.558.955	5,43	<b>Valor total de las inversiones</b>			
4.823	Amazon.com Inc.	15.843.748	3,50	<b>443.170.114 97,99</b>			
109.784	American Electric Power Company Inc.	8.912.265	1,97	<b>(Coste total: 408.264.667 USD)</b>			
32.719	Aspen Technology Inc.	4.017.893	0,89				
293.463	Bank of America Corp.	12.457.504	2,75				
251.726	Centene Corp.	15.685.047	3,47				
351.011	Cisco Systems Inc.	19.105.529	4,22				
273.204	Coca Cola Company	14.335.014	3,17				
183.355	CVS Health Corp.	15.559.505	3,44				
50.985	Doximity Inc.	4.114.490	0,91				
59.168	DuPont de Nemours Inc.	4.022.832	0,89				
167.731	Electronic Arts Inc.	23.859.734	5,28				
36.483	Estee Lauder Companies Inc.	10.942.346	2,42				
13.855	Fair Isaac Corp.	5.513.320	1,22				
84.891	Hilton Worldwide Holdings Inc.	11.214.950	2,48				
166.236	Kontoor Brands Inc.	8.303.489	1,83				
16.811	Lam Research Corp.	9.567.981	2,12				
184.298	Livent Corp.	4.259.127	0,94				
54.873	Mastercard Inc. - A	19.078.245	4,21				
40.175	Mirati Therapeutics Inc.	7.107.359	1,57				
226.788	Morgan Stanley	22.068.740	4,89				
74.211	nCino Inc.	5.271.207	1,17				
35.066	Paypal Holdings Inc.	9.124.524	2,02				
182.308	Renewable Energy Group Inc.	9.151.862	2,02				
53.881	Salesforce.com Inc.	14.613.605	3,23				
92.197	Schnitzer Steel Industries Inc.	4.039.151	0,89				
75.086	State Street Corp.	6.361.286	1,41				
16.166	Svb Financial Group	10.457.462	2,31				
74.344	Target Corp.	17.007.677	3,77				
30.181	Teradata Corp.	1.730.880	0,38				
41.717	TransUnion	4.685.236	1,04				
74.505	Union Pacific Corp.	14.603.725	3,23				
95.566	United Parcel Service Inc.	17.402.569	3,85				
59.020	Vertex Pharmaceuticals Inc.	10.705.638	2,37				
78.852	VF Corp.	5.282.295	1,17				
75.044	Voya Financial Inc.	4.606.951	1,02				

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
<b>Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>			
<b>Fondos</b>			
<b>IRLANDA</b>			
564.656	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	564.656	0,17
	<b>Total de Irlanda</b>	<b>564.656</b>	<b>0,17</b>
	<b>Total de fondos</b>	<b>564.656</b>	<b>0,17</b>
	<b>Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>	<b>564.656</b>	<b>0,17</b>
	<b>Valor total de las inversiones</b>	<b>330.681.370</b>	<b>98,85</b>
<b>(Coste total: 277.320.834 USD)</b>			

## Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity

### Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2021

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>			
<b>Renta variable</b>				<b>Renta variable (continuación)</b>			
<b>AUSTRALIA</b>				<b>HONG KONG</b>			
123.320	Amcor plc	1.468.042	1,19	365.000	AIA Group Limited	4.217.501	3,41
85.230	Aristocrat Leisure Limited	2.890.519	2,34	209.500	Boc Hong Kong Holdings Limited	632.431	0,51
185.521	Australia & New Zealand Banking Group Limited	3.772.412	3,05	166.400	Galaxy Entertainment Group Limited	855.016	0,69
45.563	BHP Group Limited	1.237.837	1,00	620.000	Guangdong Investment Limited	809.183	0,65
154.297	Lendlease Corp. Limited	1.209.302	0,98	74.521	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	4.593.039	3,71
29.113	Macquarie Group Limited	3.827.419	3,10	505.600	Hua Hong Semiconductor Limited	2.623.914	2,12
119.285	Newcrest Mining Limited	1.950.787	1,58	47.000	Sun Hung Kai Properties Limited	588.055	0,48
18.472	Rio Tinto Limited	1.336.726	1,08				
	<b>Total de Australia</b>	<b>17.693.044</b>	<b>14,32</b>		<b>Total de Hong Kong</b>	<b>14.319.139</b>	<b>11,57</b>
<b>ISLAS CAIMÁN</b>				<b>INDIA</b>			
297.516	Alibaba Group Holding Limited	5.434.644	4,39	42.511	Godrej Consumer Products Limited	589.832	0,48
301.300	ASM Pacific Technology Limited	3.334.384	2,70	102.686	Reliance Industries Limited	3.485.095	2,82
57.900	Baidu Inc. - A	1.103.757	0,89	12.845	Tata Consultancy Services Limited	653.351	0,53
229.000	China Mengniu Dairy Company Limited	1.475.256	1,20	133.889	Tech Mahindra Limited	2.490.261	2,01
44.248	Dada Nexus Limited	886.730	0,72	125.759	UPL Limited	1.199.004	0,97
34.500	JD.com Inc	1.255.086	1,01		<b>Total de India</b>	<b>8.417.543</b>	<b>6,81</b>
107.400	NetEase Inc.	1.814.225	1,47				
142.700	Tencent Holdings Limited	8.457.903	6,85	<b>INDONESIA</b>			
50.600	Wuxi Biologics Cayman Inc.	822.247	0,66	26.688.900	Bukalapak.com PT Tbk	1.603.688	1,30
132.000	Xiaomi Corp. - B	362.020	0,29	2.711.300	Indofood Cbp Sukses Makmur Tbk Pt	1.581.812	1,28
60.916	XPeng Inc.	1.056.395	0,85	15.942.200	Kalbe Farma Tbk Pt	1.592.851	1,29
	<b>Total de Islas Caimán</b>	<b>26.002.647</b>	<b>21,03</b>		<b>Total de Indonesia</b>	<b>4.778.351</b>	<b>3,87</b>
<b>CHINA</b>				<b>REPÚBLICA DE COREA (SUR)</b>			
525.000	A-Living Services Company Limited - H	1.868.101	1,51	48.557	Hana Financial Group Inc.	1.902.899	1,54
1.113.600	China Construction Bank Corp.	798.224	0,65	101.248	Hanon Systems	1.338.279	1,08
30.500	China International Travel Service Corp. Limited - A	1.228.698	0,99	69.583	Mando Corp.	3.355.716	2,72
655.300	Foxconn Industrial Internet Company Limited	1.179.827	0,95	8.476	Samsung Electro-Mechanics Company Limited	1.270.677	1,03
127.900	Inner Mongolia Yili Industrial Group Company Limited - A	747.109	0,60	125.944	Samsung Electronics Company Limited	7.882.093	6,37
126.400	Midea Group Company Limited - A	1.363.102	1,10	2.954	Samsung Sdi Company Limited	1.791.352	1,45
328.000	Ping An Insurance Group Company of China Limited	2.243.647	1,81	3.135	SK IE Technology Company Limited	598.400	0,48
1.265.000	Times Property Holdings Limited	1.051.371	0,85		<b>Total de República de Corea (Sur)</b>	<b>18.139.416</b>	<b>14,67</b>
332.737	Venustech Group Inc. - A	1.423.441	1,15				
12.000	Wuliangye Yibin Company Limited - A	407.915	0,33				
	<b>Total de China</b>	<b>12.311.435</b>	<b>9,94</b>				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.



## Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity

### Estado de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>			
<b>Renta variable (continuación)</b>			
<b>TAIWÁN</b>			
83.000	MediaTek Inc.	2.696.103	2,18
573.000	Powertech Technology Inc.	2.149.219	1,74
573.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	11.928.679	9,64
203.000	Yageo Corp.	3.224.178	2,61
	<b>Total de Taiwán</b>	<b>19.998.179</b>	<b>16,17</b>
<b>TAILANDIA</b>			
2.749.100	Thai Beverage plc	1.326.356	1,07
	<b>Total de Tailandia</b>	<b>1.326.356</b>	<b>1,07</b>
	<b>Total de renta variable</b>	<b>122.986.110</b>	<b>99,45</b>
	<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>	<b>122.986.110</b>	<b>99,45</b>
<b>Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>			
<b>Fondos</b>			
<b>IRLANDA</b>			
518.057	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	518.057	0,42
	<b>Total de Irlanda</b>	<b>518.057</b>	<b>0,42</b>
	<b>Total de fondos</b>	<b>518.057</b>	<b>0,42</b>
	<b>Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>	<b>518.057</b>	<b>0,42</b>
	<b>Valor total de las inversiones</b>	<b>123.504.167</b>	<b>99,87</b>
<b>(Coste total: 99.634.471 USD)</b>			



## Threadneedle (Lux) - Asia Equities

### Estado de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>			
<b>Renta variable (continuación)</b>			
<b>SINGAPUR</b>			
1.136.800	Keppel Corp. Limited	4.371.020	1,39
314.300	United Overseas Bank Limited	5.984.572	1,90
	<b>Total de Singapur</b>	<b>10.355.592</b>	<b>3,29</b>
<b>TAIWÁN</b>			
472.000	Chailease Holding Company Limited	4.167.608	1,32
549.000	Chroma ATE Inc.	3.468.125	1,10
266.000	Delta Electronics Inc.	2.405.980	0,76
1.347.000	Hon Hai Precision Industry Company Limited	5.076.527	1,61
232.000	MediaTek Inc.	7.536.094	2,39
1.317.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	27.417.226	8,72
	<b>Total de Taiwán</b>	<b>50.071.560</b>	<b>15,90</b>
	<b>Total de renta variable</b>	<b>314.114.018</b>	<b>99,75</b>
<b>Derechos</b>			
<b>INDIA</b>			
33.535	Bharti Airtel Limited Right	69.258	0,02
	<b>Total de India</b>	<b>69.258</b>	<b>0,02</b>
	<b>Total de derechos</b>	<b>69.258</b>	<b>0,02</b>
	<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>	<b>314.183.276</b>	<b>99,77</b>
<b>Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>			
<b>Fondos</b>			
<b>IRLANDA</b>			
3.283.200	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	3.283.200	1,04
	<b>Total de Irlanda</b>	<b>3.283.200</b>	<b>1,04</b>
	<b>Total de fondos</b>	<b>3.283.200</b>	<b>1,04</b>
	<b>Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>	<b>3.283.200</b>	<b>1,04</b>
	<b>Valor total de las inversiones</b>	<b>317.466.476</b>	<b>100,81</b>
<b>(Coste total: 243.567.396 USD)</b>			

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
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>			
<b>Renta variable (continuación)</b>			
<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>			
34.436	Walt Disney Company	5.825.538	1,16
22.243	Western Digital Corp.	1.255.395	0,25
	<b>Total de Estados Unidos</b>	<b>466.490.824</b>	<b>93,01</b>
	<b>Total de renta variable</b>	<b>493.747.834</b>	<b>98,44</b>
	<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>	<b>493.747.834</b>	<b>98,44</b>
	<b>Valor total de las inversiones</b>	<b>493.747.834</b>	<b>98,44</b>
<b>(Coste total: 339.923.721 USD)</b>			

## Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities

### Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2021

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>			
<b>Renta variable</b>				<b>Renta variable (continuación)</b>			
<b>IRLANDA</b>				<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>			
4.972	Accenture plc	1.590.642	2,24	706	HCA Healthcare Inc	171.360	0,24
2.506	Johnson Controls International plc	170.608	0,24	898	Humana Inc.	349.457	0,49
	<b>Total de Irlanda</b>	<b>1.761.250</b>	<b>2,48</b>	5.549	Intel Corp.	295.651	0,42
				5.796	International Paper Company	324.112	0,46
				31.344	Interpublic Group of Companies Inc.	1.149.384	1,62
				5.176	Iqvia Holdings Inc.	1.239.859	1,76
				5.244	Johnson & Johnson	846.906	1,20
				49.186	Kinder Morgan Inc.	822.882	1,16
				11.786	Kroger Company	476.508	0,67
				3.136	Lennar Corp.	293.780	0,41
				1.451	Mastercard Inc. - A	504.484	0,71
				3.612	McKesson Corp.	720.161	1,02
				6.412	Metlife Inc.	395.813	0,56
				14.422	Microsoft Corp.	4.065.850	5,73
				7.911	Morgan Stanley	769.819	1,09
				2.070	Norfolk Southern Corp.	495.248	0,70
				18.672	NRG Energy Inc.	762.378	1,07
				977	Nucor Corp.	96.225	0,14
				480	O'Reilly Automotive Inc.	293.309	0,41
				3.665	Parker Hannifin Corp.	1.024.807	1,45
				39.780	Pfizer Inc.	1.710.937	2,40
				6.174	Philip Morris International Inc.	585.233	0,83
				2.347	PPL Corp.	65.434	0,09
				7.787	Procter & Gamble Company	1.088.623	1,54
				1.940	Public Storage Inc.	576.374	0,81
				16.303	Pulte Homes Inc.	748.634	1,06
				2.860	Qualcomm Inc.	368.883	0,52
				410	Regeneron Pharmaceuticals Inc.	248.124	0,35
				2.835	Robert Half International Inc.	284.436	0,40
				8.185	Ross Stores Inc.	890.937	1,26
				262	S&P Global Inc.	111.321	0,16
				2.037	Simon Property Group Inc.	264.749	0,37
				4.291	Snap-On Inc.	896.604	1,27
				1.686	Southwest Airlines Company	86.711	0,12
				8.073	Starbucks Corp.	890.533	1,26
				5.516	T Rowe Price Group Inc.	1.084.998	1,53
				1.087	Tapestry Inc.	40.241	0,06
				4.456	Target Corp.	1.019.398	1,43
				574	Tesla Motors Inc.	445.126	0,63
				12.334	Tyson Foods Inc. - A	973.646	1,37
				5.306	United Parcel Service Inc.	966.222	1,36
				1.618	VeriSign Inc.	331.706	0,47
				5.490	Verizon Communications Inc.	296.515	0,42
				1.685	Vertex Pharmaceuticals Inc.	305.642	0,43
				1	Victoria's SE	55	0,00

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities

### Estado de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>			
<b>Renta variable (continuación)</b>			
<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>			
627	Voya Financial Inc.	38.492	0,05
35.571	Weyerhaeuser Company	1.265.260	1,79
	<b>Total de Estados Unidos</b>	<b>69.350.318</b>	<b>97,88</b>
	<b>Total de renta variable</b>	<b>71.111.568</b>	<b>100,36</b>
	<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>	<b>71.111.568</b>	<b>100,36</b>
	<b>Valor total de las inversiones</b>	<b>71.111.568</b>	<b>100,36</b>
<b>(Coste total: 67.627.291 USD)</b>			

## Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities

### Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2021

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>			
<b>Renta variable</b>				<b>Renta variable (continuación)</b>			
<b>BÉLGICA</b>				<b>ITALIA</b>			
123.203	KBC Group NV	9.614.762	2,20	655.822	Enel SpA	4.361.872	1,00
	<b>Total de Bélgica</b>	<b>9.614.762</b>	<b>2,20</b>	401.784	Nexi SpA	6.492.829	1,49
				759.045	UniCredit SpA	8.729.018	2,00
					<b>Total de Italia</b>	<b>19.583.719</b>	<b>4,49</b>
<b>DINAMARCA</b>				<b>PAÍSES BAJOS</b>			
32.837	DSV A/S	6.802.829	1,56	15.404	ASM International NV	5.209.633	1,19
140.515	Novo-Nordisk A/S	11.742.440	2,69	26.954	ASML Holding NV	17.409.588	3,97
35.960	Orsted AS	4.104.776	0,94	27.260	IMCD Group NV	4.504.715	1,03
244.682	Tryg A/S	4.800.890	1,10	861.870	ING Groep NV	10.831.982	2,47
	<b>Total de Dinamarca</b>	<b>27.450.935</b>	<b>6,29</b>	127.099	STMicroelectronics NV	4.799.894	1,10
					<b>Total de Países Bajos</b>	<b>42.755.812</b>	<b>9,76</b>
<b>FINLANDIA</b>				<b>NORUEGA</b>			
131.264	Neste Oyj	6.427.998	1,47	448.991	DNB Bank ASA	8.873.930	2,03
	<b>Total de Finlandia</b>	<b>6.427.998</b>	<b>1,47</b>		<b>Total de Noruega</b>	<b>8.873.930</b>	<b>2,03</b>
<b>FRANCIA</b>				<b>ESPAÑA</b>			
419.314	AXA SA	10.099.177	2,31	188.090	Inditex SA	5.985.024	1,37
181.657	BNP Paribas	10.071.064	2,30		<b>Total de España</b>	<b>5.985.024</b>	<b>1,37</b>
104.835	Dassault Systemes SE	4.766.323	1,09				
7.765	Kering	4.783.240	1,09				
30.448	L'Oreal SA	10.865.369	2,49				
21.330	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	13.226.733	3,02				
127.193	Publicis Groupe SA	7.410.264	1,69				
41.467	Schneider Electric SE	5.967.101	1,36				
37.194	Teleperformance	12.649.680	2,90				
65.504	Worldline SA	4.323.919	0,99				
	<b>Total de Francia</b>	<b>84.162.870</b>	<b>19,24</b>				
<b>ALEMANIA</b>				<b>SUECIA</b>			
42.651	Allianz SE - Reg	8.310.121	1,90	110.950	Atlas Copco AB - A	5.823.750	1,33
98.298	Brenntag AG	7.920.853	1,81	480.684	Sandvik AB	9.538.677	2,18
75.651	Daimler AG - Reg	5.803.945	1,33		<b>Total de Suecia</b>	<b>15.362.427</b>	<b>3,51</b>
244.463	Infineon Technologies AG	8.684.548	1,99				
84.167	Puma AG Rudolf Dassler Sport	8.115.382	1,86				
37.998	Volkswagen AG Pfd	7.357.932	1,68				
71.453	Zalando SE	5.667.652	1,30				
	<b>Total de Alemania</b>	<b>51.860.433</b>	<b>11,87</b>				
<b>IRLANDIA</b>				<b>SUIZA</b>			
224.304	CRH plc	9.107.527	2,09	11.093	Lonza Group AG - Reg	7.198.835	1,65
68.202	CRH plc	2.766.273	0,63	88.357	Nestle SA - Reg	9.210.612	2,11
101.910	Kingspan Group plc	8.764.260	2,00	3.506	Partners Group Holding AG - Reg	4.755.734	1,09
	<b>Total de Irlanda</b>	<b>20.638.060</b>	<b>4,72</b>	30.398	Roche Holding AG	9.614.600	2,20
				242.094	SIG Combibloc Group AG	5.580.276	1,28
				47.279	Sika AG	12.979.435	2,97
				313.982	UBS Group AG	4.356.318	1,00
					<b>Total de Suiza</b>	<b>53.695.810</b>	<b>12,30</b>
<b>REINO UNIDO</b>							
				729.832	3i Group plc	10.881.269	2,48
				141.054	Ashtead Group plc	9.265.403	2,11
				104.577	Astrazeneca plc	10.898.965	2,49
				712.380	JD Sports Fashion plc	8.689.968	1,99
				34.773	Linde plc	8.905.365	2,04

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
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>			
<b>Renta variable (continuación)</b>			
<b>REINO UNIDO (continuación)</b>			
284.034	Persimmon plc	8.816.459	2,02
158.634	Rio Tinto plc	9.068.287	2,07
553.370	St James's Place plc	9.702.125	2,22
4.169.691	Vodafone Group plc	5.496.317	1,26
111.525	Whitbread plc	4.302.539	0,98
	<b>Total del Reino Unido</b>	<b>86.026.697</b>	<b>19,66</b>
	<b>Total de renta variable</b>	<b>432.438.477</b>	<b>98,91</b>
	<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>	<b>432.438.477</b>	<b>98,91</b>
<b>Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>			
<b>Fondos</b>			
<b>IRLANDA</b>			
50.754	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	5.002.607	1,14
	<b>Total de Irlanda</b>	<b>5.002.607</b>	<b>1,14</b>
	<b>Total de fondos</b>	<b>5.002.607</b>	<b>1,14</b>
	<b>Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>	<b>5.002.607</b>	<b>1,14</b>
	<b>Valor total de las inversiones</b>	<b>437.441.084</b>	<b>100,05</b>
<b>(Coste total: 346.494.852 EUR)</b>			

## Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend

### Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2021

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>			
<b>Renta variable</b>				<b>Renta variable (continuación)</b>			
<b>BÉLGICA</b>				<b>ITALIA</b>			
7.375	Aedifica	795.025	1,04	252.193	Enel SpA	1.677.335	2,19
27.940	KBC Group NV	2.180.437	2,85	119.110	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	1.147.744	1,50
19.828	Melexis NV	1.824.176	2,38	86.047	Nexi SpA	1.390.519	1,81
	<b>Total de Bélgica</b>	<b>4.799.638</b>	<b>6,27</b>		<b>Total de Italia</b>	<b>4.215.598</b>	<b>5,50</b>
<b>DINAMARCA</b>				<b>JERSEY - ISLAS DEL CANAL</b>			
122.419	Tryg A/S	2.401.976	3,14	183.820	WPP plc	2.139.675	2,80
	<b>Total de Dinamarca</b>	<b>2.401.976</b>	<b>3,14</b>		<b>Total de Jersey - Islas del Canal</b>	<b>2.139.675</b>	<b>2,80</b>
<b>FINLANDIA</b>				<b>PAÍSES BAJOS</b>			
22.051	Neste Oyj	1.079.837	1,41	7.229	ASM International NV	2.444.848	3,20
36.833	Upm-Kymmene Oyj	1.131.141	1,48	113.924	ING Groep NV	1.431.797	1,87
	<b>Total de Finlandia</b>	<b>2.210.978</b>	<b>2,89</b>	7.071	Koninklijke DSM NV	1.221.515	1,60
				19.991	Philips NV	766.455	1,00
<b>FRANCIA</b>				<b>Total de Países Bajos</b>			
8.394	Air Liquide SA	1.163.241	1,52		<b>5.864.615</b>	<b>7,67</b>	
16.892	Antin Infrastructure Partners SA	491.557	0,64	<b>ESPAÑA</b>			
86.880	AXA SA	2.092.505	2,73	175.476	Iberdrola SA	1.523.834	1,99
26.443	Edenred	1.233.037	1,61	79.501	Inditex SA	2.529.722	3,31
3.643	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	2.259.024	2,95		<b>Total de España</b>	<b>4.053.556</b>	<b>5,30</b>
36.281	Nexity	1.494.777	1,95	<b>SUECIA</b>			
5.583	Pernod-Ricard SA	1.064.678	1,39	22.592	Atlas Copco AB	999.350	1,31
11.451	Schneider Electric SE	1.647.799	2,15	65.737	Sandvik AB	1.304.483	1,70
59.533	TotalEnergies SE	2.460.797	3,22	89.629	Volvo AB - B	1.741.997	2,27
65.817	Verallia Sasu	1.961.347	2,56		<b>Total de Suecia</b>	<b>4.045.830</b>	<b>5,28</b>
19.323	Vinci SA	1.741.968	2,28	<b>SUIZA</b>			
	<b>Total de Francia</b>	<b>17.610.730</b>	<b>23,00</b>	16.883	Nestle SA - Reg	1.759.937	2,30
<b>ALEMANIA</b>				998	Vat Group AG	341.736	0,45
26.112	Brenntag AG	2.104.106	2,75		<b>Total de Suiza</b>	<b>2.101.673</b>	<b>2,75</b>
16.350	Siemens AG - Reg	2.320.392	3,03	<b>REINO UNIDO</b>			
13.382	Siemens Healthineers AG	751.801	0,98	176.389	3i Group plc	2.629.833	3,44
8.834	Volkswagen AG Pfd	1.710.616	2,24	21.258	Astrazeneca plc	2.215.498	2,90
21.292	Vonovia SE	1.105.055	1,44	75.101	Glaxosmithkline plc	1.226.386	1,60
	<b>Total de Alemania</b>	<b>7.991.970</b>	<b>10,44</b>	610.148	lbstock plc	1.469.412	1,92
<b>IRLANDA</b>				15.173	London Stock Exchange Group plc	1.315.121	1,72
42.414	CRH plc	1.722.157	2,25	48.361	Persimmon plc	1.501.133	1,96
13.581	Medtronic Inc.	1.468.897	1,92	25.175	Rio Tinto plc	1.439.125	1,88
	<b>Total de Irlanda</b>	<b>3.191.054</b>	<b>4,17</b>				

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
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>			
<b>Renta variable (continuación)</b>			
<b>REINO UNIDO (continuación)</b>			
98.580	St James's Place plc	1.728.383	2,26
1.353.238	Vodafone Group plc	1.783.783	2,33
	<b>Total del Reino Unido</b>	<b>15.308.674</b>	<b>20,01</b>
	<b>Total de renta variable</b>	<b>75.935.967</b>	<b>99,22</b>
	<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>	<b>75.935.967</b>	<b>99,22</b>
	<b>Valor total de las inversiones</b>	<b>75.935.967</b>	<b>99,22</b>
<b>(Coste total: 67.528.837 EUR)</b>			

## Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities

### Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2021

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>			
<b>Renta variable</b>				<b>Renta variable (continuación)</b>			
<b>BÉLGICA</b>				<b>IRLANDA</b>			
196.656	Azelis Group NV	5.349.043	0,52	2.302.312	Dalata Hotel Group Limited	9.439.479	0,92
647.286	Fagron	10.939.134	1,07	1.533.724	Irish Continental Group plc	6.618.019	0,65
176.772	Melexis NV	16.263.024	1,59				
	<b>Total de Bélgica</b>	<b>32.551.201</b>	<b>3,18</b>		<b>Total de Irlanda</b>	<b>16.057.498</b>	<b>1,57</b>
<b>DINAMARCA</b>				<b>ISLA DE MAN</b>			
139.229	Simcorp A/S	14.226.347	1,39	3.472.343	Strix Group plc	13.795.942	1,35
	<b>Total de Dinamarca</b>	<b>14.226.347</b>	<b>1,39</b>		<b>Total de Isla de Man</b>	<b>13.795.942</b>	<b>1,35</b>
<b>FINLANDIA</b>				<b>ITALIA</b>			
318.459	Huhtamaki Oyj	12.419.901	1,21	677.266	Carel Industries SpA	15.949.614	1,56
174.284	Musti Group Oyj	5.385.376	0,53	39.232	Diasorin SpA	7.114.723	0,69
116.980	Revenio Group Oyj	6.416.353	0,63	424.236	GVS SpA	5.218.103	0,51
239.959	Vaisala Oyj	9.010.460	0,88	553.495	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	5.333.478	0,52
	<b>Total de Finlandia</b>	<b>33.232.090</b>	<b>3,25</b>	390.533	Marr SpA	8.255.868	0,81
					<b>Total de Italia</b>	<b>41.871.786</b>	<b>4,09</b>
<b>FRANCIA</b>				<b>JERSEY - ISLAS DEL CANAL</b>			
643.424	Elis SA	10.661.536	1,04	1.977.047	JTC plc	17.113.071	1,67
647.768	Korian SA	19.614.415	1,92				
416.210	Lectra	14.130.330	1,38		<b>Total de Jersey - Islas del Canal</b>	<b>17.113.071</b>	<b>1,67</b>
83.683	Orpea SA	8.426.878	0,82				
42.033	Remy Cointreau SA	7.040.528	0,69				
450.045	Verallia Sasu	13.411.341	1,31				
	<b>Total de Francia</b>	<b>73.285.028</b>	<b>7,16</b>				
<b>ALEMANIA</b>				<b>LUXEMBURGO</b>			
375.986	Cancom AG	19.258.003	1,88	634.521	Global Fashion Group SA	6.100.919	0,60
156.637	Cherry AG	5.012.384	0,49		<b>Total de Luxemburgo</b>	<b>6.100.919</b>	<b>0,60</b>
269.540	CompuGroup Medical SE & Company KgaA	19.164.294	1,87				
383.645	CTS Eventim AG	25.052.018	2,44				
88.446	Dermapharm Holding SE	7.376.396	0,72				
139.089	Gerresheimer AG	11.794.747	1,15				
20.758	Hypoport AG	12.101.914	1,18				
122.463	Nemetschek SE	11.107.394	1,08				
244.276	Norma Group	8.945.387	0,87				
238.708	Stabilus GmbH	14.453.770	1,41				
91.160	Stratec Biomedical AG	11.157.984	1,09				
284.978	TeamViewer AG	7.235.591	0,71				
	<b>Total de Alemania</b>	<b>152.659.882</b>	<b>14,89</b>				
<b>ISLANDIA</b>				<b>PAÍSES BAJOS</b>			
2.174.699	Marel HF	12.830.724	1,25	63.062	IMCD Group NV	10.420.996	1,02
	<b>Total de Islandia</b>	<b>12.830.724</b>	<b>1,25</b>	39.385	Shop Apotheke Europe NV	5.029.465	0,49
					<b>Total de Países Bajos</b>	<b>15.450.461</b>	<b>1,51</b>
				<b>NORUEGA</b>			
				1.485.017	Link Mobility Group Holding ASA	4.983.427	0,49
					<b>Total de Noruega</b>	<b>4.983.427</b>	<b>0,49</b>
				<b>ESPAÑA</b>			
				758.907	Applus Services SA	6.245.805	0,61
				723.818	Fluidra SA	24.935.530	2,43
					<b>Total de España</b>	<b>31.181.335</b>	<b>3,04</b>
				<b>SUECIA</b>			
				724.626	Avanza Bank Holding AB	22.126.635	2,15

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.



## Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies

### Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2021

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>			
<b>Renta variable</b>				<b>Renta variable (continuación)</b>			
<b>BÉLGICA</b>				<b>ALEMANIA (continuación)</b>			
430.151	Azelis Group NV	11.700.107	0,52	194.617	Stratec Biomedical AG	23.821.121	1,07
100.645	Melexis NV	9.259.340	0,41	576.609	TeamViewer AG	14.640.103	0,65
460.716	Umicore SA	23.607.088	1,05		<b>Total de Alemania</b>	<b>382.444.951</b>	<b>17,07</b>
	<b>Total de Bélgica</b>	<b>44.566.535</b>	<b>1,98</b>				
<b>DINAMARCA</b>				<b>ISLANDIA</b>			
318.986	Simcorp A/S	32.593.823	1,46	4.222.197	Marel HF	24.910.963	1,11
1.178.666	Tryg A/S	23.126.529	1,03		<b>Total de Islandia</b>	<b>24.910.963</b>	<b>1,11</b>
	<b>Total de Dinamarca</b>	<b>55.720.352</b>	<b>2,49</b>				
<b>FINLANDIA</b>				<b>IRLANDA</b>			
707.800	Huhtamaki Oyj	27.604.200	1,23	5.300.341	Dalata Hotel Group Limited	21.731.398	0,97
205.512	Revenio Group Oyj	11.272.333	0,50	4.153.766	Irish Continental Group plc	17.923.500	0,80
	<b>Total de Finlandia</b>	<b>38.876.533</b>	<b>1,73</b>	141.093	Kingspan Group plc	12.133.998	0,54
					<b>Total de Irlanda</b>	<b>51.788.896</b>	<b>2,31</b>
<b>FRANCIA</b>				<b>ITALIA</b>			
1.007.580	Bureau Veritas SA	26.912.462	1,21	190.157	Diasorin SpA	34.484.972	1,54
302.160	Edenred	14.089.721	0,63	2.369.020	Finecobank Banca Fineco SpA	37.122.543	1,66
1.989.964	Elis SA	32.973.704	1,48	1.054.312	GVS SpA	12.968.038	0,58
1.072.889	Korian SA	32.487.079	1,45	2.475.294	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	23.851.933	1,07
185.006	Nexity	7.622.247	0,34	876.611	Marr SpA	18.531.557	0,83
313.345	Orpea SA	31.553.842	1,41	1.277.251	Nexi SpA	20.640.376	0,92
90.811	Remy Cointreau SA	15.210.843	0,68		<b>Total de Italia</b>	<b>147.599.419</b>	<b>6,60</b>
108.748	SEB SA	13.256.381	0,59				
47.775	Teleperformance	16.248.278	0,73				
214.521	Ubisoft Entertainment SA	11.129.349	0,50		<b>JERSEY - ISLAS DEL CANAL</b>		
1.109.502	Verallia Sasu	33.063.160	1,48	598.543	JTC plc	5.180.913	0,23
131.916	Worldline SA	8.707.775	0,39	2.138.325	Sanne Group plc	22.464.641	1,00
	<b>Total de Francia</b>	<b>243.254.841</b>	<b>10,89</b>		<b>Total de Jersey - Islas del Canal</b>	<b>27.645.554</b>	<b>1,23</b>
<b>ALEMANIA</b>				<b>LUXEMBURGO</b>			
260.258	Brenntag AG	20.971.590	0,94	488.478	Eurofins Scientific SE	54.142.901	2,43
720.807	Cancom AG	36.919.735	1,65	1.177.273	Global Fashion Group SA	11.319.480	0,51
88.174	Carl Zeiss Meditec AG	14.641.293	0,65		<b>Total de Luxemburgo</b>	<b>65.462.381</b>	<b>2,94</b>
675.409	CompuGroup Medical SE & Company KgaA	48.021.579	2,15				
789.862	CTS Eventim AG	51.577.989	2,30		<b>PAÍSES BAJOS</b>		
185.876	Dermapharm Holding SE	15.502.058	0,69	104.377	ASM International NV	35.300.301	1,58
298.004	Gerresheimer AG	25.270.739	1,13	900.651	Davide Campari-Milano NV	10.969.929	0,49
36.208	Hypoport AG	21.109.264	0,94	275.164	IMCD Group NV	45.470.851	2,04
149.368	Nemetschek SE	13.547.678	0,61	172.731	Just Eat Takeaway.com NV	10.847.788	0,48
485.189	Norma Group	17.767.621	0,79	73.572	Shop Apotheke Europe NV	9.395.144	0,42
227.696	Puma AG Rudolf Dassler Sport	21.954.448	0,98		<b>Total de Países Bajos</b>	<b>111.984.013</b>	<b>5,01</b>
62.395	Sartorius AG	34.304.771	1,52				
369.859	Stabilus GmbH	22.394.962	1,00				

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
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>			
<b>Renta variable (continuación)</b>				<b>Renta variable (continuación)</b>			
<b>ESPAÑA</b>				<b>REINO UNIDO (continuación)</b>			
1.624.114	Applus Services SA	13.366.458	0,60	3.736.995	Synthomer plc	21.634.203	0,97
1.671.034	Fluidra SA	57.567.121	2,57	1.275.818	Victoria plc	13.715.092	0,61
	<b>Total de España</b>	<b>70.933.579</b>	<b>3,17</b>	729.923	Victrex plc	20.228.181	0,90
				2.742.222	Watches of Switzerland Group plc	30.180.872	1,35
<b>SUECIA</b>				<b>Total del Reino Unido</b>			
1.736.208	Avanza Bank Holding AB	53.015.545	2,38			<b>623.264.361</b>	<b>27,83</b>
2.604.009	Elekta AB - B	25.256.503	1,13	<b>Total de renta variable</b>			
275.581	Fortnox AB	14.405.412	0,64			<b>2.215.110.150</b>	<b>98,96</b>
679.563	Intrum Justitia AB	15.991.923	0,71	<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>			
818.297	Nordnet AB	12.703.290	0,57			<b>2.215.110.150</b>	<b>98,96</b>
1.321.110	Stillfront Group AB	7.231.568	0,32	<b>Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>			
597.069	Thule Group AB	26.004.836	1,16	<b>Fondos</b>			
	<b>Total de Suecia</b>	<b>154.609.077</b>	<b>6,91</b>	<b>IRLANDA</b>			
<b>SUIZA</b>				225.498	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	22.226.289	0,99
76.780	Belimo Holding AG	35.083.157	1,57	<b>Total de Irlanda</b>			
13.287	Inficon Holding AG	13.469.798	0,60			<b>22.226.289</b>	<b>0,99</b>
2.231.592	SIG Combibloc Group AG	51.438.280	2,30	<b>Total de fondos</b>			
41.550	Sika AG	11.406.661	0,51			<b>22.226.289</b>	<b>0,99</b>
22.957	Tecan Group AG - Reg	11.286.051	0,50	<b>Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>			
105.777	Vat Group AG	36.220.235	1,62			<b>22.226.289</b>	<b>0,99</b>
37.997	Zur Rose Group AG	13.144.513	0,59	<b>Valor total de las inversiones</b>			
	<b>Total de Suiza</b>	<b>172.048.695</b>	<b>7,69</b>			<b>2.237.336.439</b>	<b>99,95</b>
<b>REINO UNIDO</b>				<b>(Coste total: 1.660.431.245 EUR)</b>			
729.231	Abcam plc	12.709.105	0,57				
748.069	Allfunds Group plc	12.552.598	0,56				
7.271.006	Ascential plc	34.699.896	1,55				
1.442.408	Auction Technology Group plc	22.319.157	0,99				
714.860	Aveva Group plc	29.940.670	1,34				
2.399.675	Big Yellow Group plc	38.946.161	1,74				
715.793	Blue Prism Group plc	9.576.864	0,43				
2.020.606	Cvs Group plc	56.889.880	2,54				
6.317.076	Elementis plc	10.950.662	0,49				
686.794	FD Technologies plc	18.777.266	0,84				
882.544	Future plc	37.887.919	1,69				
92.168	Games Workshop Group plc	11.012.569	0,49				
824.418	Genus plc	52.465.378	2,34				
717.817	GlobalData plc	12.318.102	0,55				
4.229.887	Howden Joinery Group plc	44.083.680	1,97				
8.774.730	Ibstock plc	21.132.074	0,94				
350.698	Renishaw plc	19.372.337	0,87				
2.652.194	Rentokil Initial plc	18.007.714	0,80				
1.969.634	RWS Holdings plc	14.356.369	0,64				
2.005.795	Shaftesbury plc	14.199.895	0,63				
2.584.169	St James's Place plc	45.307.717	2,03				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## Threadneedle (Lux) - European Select

### Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2021

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>			
<b>Renta variable</b>				<b>Renta variable (continuación)</b>			
<b>BÉLGICA</b>				<b>PAÍSES BAJOS (continuación)</b>			
350.356	Azelis Group NV	9.529.683	0,52	694.448	Philips NV	26.625.136	1,46
	<b>Total de Bélgica</b>	<b>9.529.683</b>	<b>0,52</b>	651.796	STMicroelectronics NV	24.615.076	1,35
<b>DINAMARCA</b>				<b>ESPAÑA</b>			
187.629	DSV A/S	38.871.032	2,13	359.854	Amadeus IT Holding SA - A	20.468.496	1,12
670.883	Novo-Nordisk A/S	56.063.787	3,07	3.103.200	Inditex SA	98.743.824	5,41
3.054.371	Tryg A/S	59.929.614	3,28		<b>Total de España</b>	<b>119.212.320</b>	<b>6,53</b>
	<b>Total de Dinamarca</b>	<b>154.864.433</b>	<b>8,48</b>				
<b>FRANCIA</b>				<b>SUECIA</b>			
113.492	Air Liquide SA	15.727.721	0,86	753.103	Atlas Copco AB - A	39.530.270	2,16
792.255	Dassault Systemes SE	36.019.874	1,97	842.913	Epiroc AB	15.130.548	0,83
194.764	Legrand SA	18.066.309	0,99	1.185.666	Sandvik AB	23.528.318	1,29
151.088	L'Oreal SA	53.915.753	2,95	1.568.591	Sinch AB	26.470.385	1,45
147.361	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	91.378.556	5,00		<b>Total de Suecia</b>	<b>104.659.521</b>	<b>5,73</b>
386.265	Pernod-Ricard SA	73.660.735	4,03				
410.428	Schneider Electric SE	59.060.589	3,23		<b>SUIZA</b>		
1.102.078	Worldline SA	72.748.168	3,98	80.102	Lonza Group AG - Reg	51.982.426	2,84
	<b>Total de Francia</b>	<b>420.577.705</b>	<b>23,01</b>	898.858	Nestle SA - Reg	93.699.788	5,13
<b>ALEMANIA</b>				118.868	Roche Holding AG	37.596.825	2,06
1.078.901	Brenntag AG	86.937.843	4,75	124.385	Schindler Holding AG	28.900.892	1,58
619.357	SAP SE	72.390.446	3,96	167.150	Sika AG	45.887.445	2,51
1.343.277	Siemens Healthineers AG	75.465.302	4,13	88.744	Vat Group AG	30.387.783	1,66
643.841	Zalando SE	51.069.468	2,79		<b>Total de Suiza</b>	<b>288.455.159</b>	<b>15,78</b>
	<b>Total de Alemania</b>	<b>285.863.059</b>	<b>15,63</b>				
<b>ITALIA</b>				<b>REINO UNIDO</b>			
1.752.696	Fincobank Banca Fineco SpA	27.464.746	1,50	1.528.010	Allfunds Group plc	25.640.008	1,41
1.197.457	Nexi SpA	19.350.905	1,06		<b>Total del Reino Unido</b>	<b>25.640.008</b>	<b>1,41</b>
	<b>Total de Italia</b>	<b>46.815.651</b>	<b>2,56</b>				
<b>PAÍSES BAJOS</b>				<b>Total de renta variable</b>			
8.493	Adyen NV	20.510.595	1,12			<b>1.805.905.415</b>	<b>98,83</b>
386.551	Akzo Nobel NV	36.482.683	2,00		<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>	<b>1.805.905.415</b>	<b>98,83</b>
126.417	ASML Holding NV	81.652.740	4,47				
3.675.871	Davide Campari-Milano NV	44.772.109	2,45				
325.857	IMCD Group NV	53.847.869	2,94				
221.819	Just Eat Takeaway.com NV	13.983.470	0,77				
276.690	Koninklijke DSM NV	47.798.198	2,62				

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
<b>Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>			
<b>Fondos</b>			
<b>IRLANDA</b>			
205.178	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	20.223.380	1,11
1.020.408	Insight Liquidity Funds plc	989.082	0,05
	<b>Total de Irlanda</b>	<b>21.212.462</b>	<b>1,16</b>
	<b>Total de fondos</b>	<b>21.212.462</b>	<b>1,16</b>
	<b>Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>	<b>21.212.462</b>	<b>1,16</b>
	<b>Valor total de las inversiones</b>	<b>1.827.117.877</b>	<b>99,99</b>
<b>(Coste total: 1.349.827.242 EUR)</b>			

## Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies

### Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2021

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>			
<b>Renta variable</b>				<b>Renta variable (continuación)</b>			
<b>BÉLGICA</b>				<b>ALEMANIA (continuación)</b>			
792.979	Azelis Group NV	21.569.029	1,04	217.008	Knorr-Bremse AG	20.103.621	0,97
495.413	Melexis NV	45.577.996	2,20	409.138	Nemetschek SE	37.108.817	1,79
557.089	Umicore SA	28.545.240	1,38	477.684	Norma Group	17.492.788	0,84
	<b>Total de Bélgica</b>	<b>95.692.265</b>	<b>4,62</b>	264.828	Puma AG Rudolf Dassler Sport	25.534.716	1,23
				74.214	Sartorius AG	40.802.857	1,96
				265.561	Stabilus GmbH	16.079.719	0,78
				274.416	Stratec Biomedical AG	33.588.519	1,62
				543.627	TeamViewer AG	13.802.690	0,67
					<b>Total de Alemania</b>	<b>449.566.090</b>	<b>21,68</b>
<b>DINAMARCA</b>				<b>ISLANDIA</b>			
404.794	Simcorp A/S	41.361.640	1,98	4.497.898	Marel HF	26.537.598	1,29
2.019.489	Tryg A/S	39.624.262	1,91		<b>Total de Islandia</b>	<b>26.537.598</b>	<b>1,29</b>
	<b>Total de Dinamarca</b>	<b>80.985.902</b>	<b>3,89</b>				
<b>FINLANDIA</b>				<b>IRLANDA</b>			
240.544	Cargotec Corp.	10.588.747	0,51	3.258.123	Dalata Hotel Group Limited	13.358.304	0,64
843.222	Huhtamaki Oyj	32.885.658	1,59	5.464.028	Irish Continental Group plc	23.577.281	1,14
375.552	Konecranes Oyj	13.057.943	0,63	457.341	Kingspan Group plc	39.331.326	1,90
367.583	Musti Group Oyj	11.358.315	0,55		<b>Total de Irlanda</b>	<b>76.266.911</b>	<b>3,68</b>
225.168	Revenio Group Oyj	12.350.465	0,60				
473.525	Vaisala Oyj	17.780.864	0,86				
	<b>Total de Finlandia</b>	<b>98.021.992</b>	<b>4,74</b>				
<b>FRANCIA</b>				<b>ITALIA</b>			
1.530.519	Bureau Veritas SA	40.880.161	1,98	188.166	Diasorin SpA	34.123.904	1,65
332.614	Edenred	15.509.791	0,75	2.765.777	Fincobank Banca Fineco SpA	43.339.726	2,09
1.607.496	Elis SA	26.636.209	1,28	1.275.584	GVS SpA	15.689.683	0,76
519.085	Korian SA	15.717.894	0,76	2.703.878	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	26.054.568	1,26
332.636	Nexity	13.704.603	0,66	1.193.762	Marr SpA	25.236.128	1,22
326.792	Orpea SA	32.907.954	1,59	1.661.425	Nexi SpA	26.848.628	1,29
147.218	Remy Cointreau SA	24.659.015	1,19		<b>Total de Italia</b>	<b>171.292.637</b>	<b>8,27</b>
113.025	SEB SA	13.777.748	0,66				
29.748	Somfy SA	4.652.587	0,22				
54.371	Teleperformance	18.491.577	0,89				
92.649	Ubisoft Entertainment SA	4.806.630	0,23				
855.120	Verallia Sasu	25.482.576	1,23				
114.694	Worldline SA	7.570.951	0,37				
	<b>Total de Francia</b>	<b>244.797.696</b>	<b>11,81</b>				
<b>ALEMANIA</b>				<b>LUXEMBURGO</b>			
518.726	Brenntag AG	41.798.941	2,02	442.580	Eurofins Scientific SE	49.055.567	2,36
440.965	Cancom AG	22.586.227	1,09	1.070.246	Global Fashion Group SA	10.290.416	0,49
120.488	Carl Zeiss Meditec AG	20.007.032	0,96		<b>Total de Luxemburgo</b>	<b>59.345.983</b>	<b>2,85</b>
574.092	CompuGroup Medical SE & Company KgaA	40.817.941	1,97				
798.745	CTS Eventim AG	52.158.049	2,52				
188.799	Dermapharm Holding SE	15.745.837	0,76				
308.516	Gerresheimer AG	26.162.157	1,26				
44.213	Hypoport AG	25.776.179	1,24				
<b>PAÍSES BAJOS</b>							
				158.442	ASM International NV	53.585.084	2,58
				2.530.979	Davide Campari-Milano NV	30.827.324	1,49
				320.426	IMCD Group NV	52.950.397	2,55
				111.564	Just Eat Takeaway.com NV	7.032.995	0,34
				77.224	Shop Apotheke Europe NV	9.861.505	0,48
					<b>Total de Países Bajos</b>	<b>154.257.305</b>	<b>7,44</b>

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	
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario</b>				
<b>Renta variable (continuación)</b>				<b>Renta variable</b>				
<b>ESPAÑA</b>				<b>DINAMARCA</b>				
1.537.498	Applus Services SA	12.653.609	0,61	280.528	Ow Bunker A/S	0	0,00	
1.584.055	Fluidra SA	54.570.695	2,63	<b>Total de Dinamarca</b>			<b>0</b>	<b>0,00</b>
<b>Total de España</b>		<b>67.224.304</b>	<b>3,24</b>	<b>Total de renta variable</b>			<b>0</b>	<b>0,00</b>
<b>SUECIA</b>				<b>Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario</b>				
1.525.354	Avanza Bank Holding AB	46.577.066	2,24				<b>0</b>	<b>0,00</b>
831.948	Cint Group AB	8.106.878	0,39	<b>Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>				
2.396.382	Elekta AB - B	23.242.711	1,12	<b>Fondos</b>				
256.625	Fortnox AB	13.414.527	0,65	<b>IRLANDA</b>				
57.024	Hemnet Group AB	950.484	0,05	610.800	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	60.203.642	2,90	
122.453	MIPS AB	10.634.065	0,51	<b>Total de Irlanda</b>			<b>60.203.642</b>	<b>2,90</b>
903.939	Nordnet AB	14.032.801	0,68	<b>Total de fondos</b>			<b>60.203.642</b>	<b>2,90</b>
1.155.792	Stillfront Group AB	6.326.641	0,31	<b>Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>				
604.237	Thule Group AB	26.317.032	1,27	<b>Valor total de las inversiones</b>			<b>2.060.670.732</b>	<b>99,38</b>
<b>Total de Suecia</b>		<b>149.602.205</b>	<b>7,22</b>	<b>(Coste total: 1.315.548.623 EUR)</b>				
<b>SUIZA</b>								
121.630	Belimo Holding AG	55.576.508	2,68					
61.346	Burckhardt Compression Holding AG	21.391.991	1,03					
19.275	Inficon Holding AG	19.540.179	0,94					
15.321	LEM Holding SA	30.751.794	1,48					
2.167.726	SIG Combibloc Group AG	49.966.166	2,41					
144.384	Sika AG	39.637.529	1,91					
48.260	Tecan Group AG - Reg	23.725.435	1,14					
143.838	Vat Group AG	49.253.109	2,38					
35.412	Zur Rose Group AG	12.250.270	0,58					
<b>Total de Suiza</b>		<b>302.092.981</b>	<b>14,55</b>					
<b>REINO UNIDO</b>								
1.476.950	Allfunds Group plc	24.783.221	1,20					
<b>Total del Reino Unido</b>		<b>24.783.221</b>	<b>1,20</b>					
<b>Total de renta variable</b>		<b>2.000.467.090</b>	<b>96,48</b>					
<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>		<b>2.000.467.090</b>	<b>96,48</b>					



## Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income

### Estado de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>			
<b>Renta variable (continuación)</b>			
<b>TAIWÁN (continuación)</b>			
199.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	4.142.769	8,63
32.000	Yageo Corp.	508.245	1,06
	<b>Total de Taiwán</b>	<b>9.330.941</b>	<b>19,45</b>
	<b>Total de renta variable</b>	<b>48.054.566</b>	<b>100,09</b>
	<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>	<b>48.054.566</b>	<b>100,09</b>
<b>Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario</b>			
<b>Renta variable</b>			
<b>AUSTRALIA</b>			
13.258	Transurban Group	135.609	0,28
	<b>Total de Australia</b>	<b>135.609</b>	<b>0,28</b>
	<b>Total de renta variable</b>	<b>135.609</b>	<b>0,28</b>
	<b>Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario</b>	<b>135.609</b>	<b>0,28</b>
	<b>Valor total de las inversiones</b>	<b>48.190.175</b>	<b>100,37</b>
<b>(Coste total: 39.119.478 USD)</b>			



## Threadneedle (Lux) - Global Technology

### Estado de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>			
<b>Renta variable (continuación)</b>			
<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>			
12,000	Zendesk Inc.	1.396.680	0,22
	<b>Total de Estados Unidos</b>	<b>599.166.493</b>	<b>92,63</b>
	<b>Total de renta variable</b>	<b>640.938.076</b>	<b>99,09</b>
	<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>	<b>640.938.076</b>	<b>99,09</b>
	<b>Valor total de las inversiones</b>	<b>640.938.076</b>	<b>99,09</b>
<b>(Coste total: 433.885.041 USD)</b>			

## Threadneedle (Lux) - UK Equities

## Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2021

Cantidad	Inversión	Valor de mercado GBP	% de valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado GBP	% de valor liquidativo
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>			
<b>Renta variable</b>				<b>Renta variable (continuación)</b>			
<b>IRLANDA</b>				<b>REINO UNIDO (continuación)</b>			
228.418	CRH plc	7.971.789	2,35	992.117	Sage Group plc	7.040.062	2,08
95.632	Experian plc	2.973.199	0,88	155.276	Schroders plc	3.788.734	1,12
	<b>Total de Irlanda</b>	<b>10.944.988</b>	<b>3,23</b>	438.615	Smith & Nephew plc	5.644.975	1,66
				378.676	Smiths Group plc	5.456.721	1,61
				97.574	Spectris plc	3.777.089	1,12
				1.478.859	SSP Group plc	4.093.482	1,21
				441.106	St James's Place plc	6.647.467	1,96
				1.153.616	Standard Chartered plc	5.029.766	1,48
				483.131	Synthomer plc	2.404.060	0,71
				653.920	Tate & Lyle plc	4.523.819	1,33
				3.181.083	Tesco plc	8.057.683	2,37
				416.297	Unilever plc	16.672.696	4,91
				390.207	Weir Group plc	6.600.351	1,95
				237.294	Whitbread plc	7.868.669	2,32
					<b>Total del Reino Unido</b>	<b>321.150.351</b>	<b>94,68</b>
					<b>Total de renta variable</b>	<b>337.123.542</b>	<b>99,39</b>
					<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>	<b>337.123.542</b>	<b>99,39</b>
					<b>Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>		
					<b>Fondos</b>		
					<b>IRLANDA</b>		
				841.680	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	841.680	0,25
					<b>Total de Irlanda</b>	<b>841.680</b>	<b>0,25</b>
					<b>Total de fondos</b>	<b>841.680</b>	<b>0,25</b>
					<b>Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>	<b>841.680</b>	<b>0,25</b>
					<b>Valor total de las inversiones</b>	<b>337.965.222</b>	<b>99,64</b>
					<b>(Coste total: 326.338.353 GBP)</b>		

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.



## Threadneedle (Lux) - UK Equity Income

### Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2021

Cantidad	Inversión	Valor de mercado GBP	% de valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado GBP	% de valor liquidativo
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>			
<b>Renta variable</b>				<b>Renta variable (continuación)</b>			
<b>GUERNSEY - ISLAS DEL CANAL</b>				<b>REINO UNIDO (continuación)</b>			
2.875.682	Sherborne Investors Guernsey	1.775.734	0,75	4.390.096	WM Morrison Supermarkets plc	12.928.832	5,43
1.486.095	Sherborne Investors Guernsey B Limited	3.752	0,00		<b>Total del Reino Unido</b>	<b>234.087.708</b>	<b>98,31</b>
	<b>Total de Guernsey - Islas del Canal</b>	<b>1.779.486</b>	<b>0,75</b>		<b>Total de renta variable</b>	<b>235.867.194</b>	<b>99,06</b>
<b>REINO UNIDO</b>				<b>Fondos</b>			
659.057	3i Group plc	8.445.815	3,55	<b>REINO UNIDO</b>			
233.781	Astrazeneca plc	20.942.101	8,80	39.794	Electra Private Equity plc	245.927	0,11
1.054.525	BAE Systems plc	5.960.175	2,50		<b>Total del Reino Unido</b>	<b>245.927</b>	<b>0,11</b>
3.219.393	BT Group plc	5.144.590	2,16		<b>Total de fondos</b>	<b>245.927</b>	<b>0,11</b>
4.530.959	Centrica plc	2.568.148	1,08	<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>			
843.511	Chesnara plc	2.399.789	1,01			<b>236.113.121</b>	<b>99,17</b>
316.235	Compass Group	4.819.421	2,02	<b>Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>			
1.940.924	Direct Line Insurance Group plc	5.620.916	2,36	<b>Fondos</b>			
1.162.170	DS Smith plc	4.798.600	2,02	<b>IRLANDA</b>			
1.630.914	Electrocomponents plc	17.581.253	7,39	1.510.766	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	1.510.766	0,63
916.081	Elementis plc	1.364.961	0,57		<b>Total de Irlanda</b>	<b>1.510.766</b>	<b>0,63</b>
69.683	Ferguson plc	7.201.738	3,02		<b>Total de fondos</b>	<b>1.510.766</b>	<b>0,63</b>
870.228	Glaxosmithkline plc	12.214.520	5,13	<b>Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>			
90.505	Go-Ahead Group plc	730.375	0,31			<b>1.510.766</b>	<b>0,63</b>
3.163.162	Hays plc	5.114.833	2,15	<b>Valor total de las inversiones</b>			
210.863	Imi plc	3.500.326	1,47			<b>237.623.887</b>	<b>99,80</b>
671.155	Imperial Brands plc	10.459.951	4,39	<b>(Coste total: 221.262.194 GBP)</b>			
3.884.851	ITV plc	4.141.251	1,74				
309.836	JD Wetherspoon plc	3.231.589	1,36				
153.173	Johnson Matthey plc	4.112.695	1,73				
2.297.698	Legal & General Group plc	6.458.829	2,71				
2.610.706	Marks & Spencer Group plc	4.790.646	2,01				
1.812.760	Melrose Industries plc	3.155.109	1,32				
517.144	Morgan Crucible Company	1.864.304	0,78				
141.796	Morgan Sindall plc	3.381.835	1,42				
204.925	Oxford Instruments plc	4.672.290	1,96				
835.964	Pearson plc	5.950.392	2,50				
153.471	Pennon Group plc	1.738.826	0,73				
1.332.512	Phoenix Group Holdings plc	8.602.697	3,61				
1.298.295	Rank Group plc	2.233.067	0,94				
317.670	RELX plc	6.820.375	2,86				
2.250.399	Rentokil Initial plc	13.133.329	5,52				
320.660	Smiths Group plc	4.620.711	1,94				
1.449.239	Stagecoach Group plc	1.223.158	0,51				
822.479	Tate & Lyle plc	5.689.910	2,39				
1.399.233	Tesco plc	3.544.257	1,49				
178.276	Unilever plc	7.139.954	3,00				
209.577	United Utilities Group plc	2.029.544	0,85				
1.058.196	Wincanton plc	3.756.596	1,58				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity\*

### Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2021

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>			
<b>Renta variable</b>			
<b>NIGERIA</b>			
158.348	Stanbic IBTC Holdings plc	14.926	0,91
161.547.689	Standard Alliance Insurance**	0	0,00
	<b>Total de Nigeria</b>	<b>14.926</b>	<b>0,91</b>
	<b>Total de renta variable</b>	<b>14.926</b>	<b>0,91</b>
	<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>	<b>14.926</b>	<b>0,91</b>

### Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario

#### Renta variable

#### TANZANIA

14.050	Tanzania Breweries Limited	66.465	4,07
	<b>Total de Tanzania</b>	<b>66.465</b>	<b>4,07</b>

#### ZIMBABUE

193.596	Afrasia Zimbabwe Holdings Limited**	0	0,00
	<b>Total de Zimbabue</b>	<b>0</b>	<b>0,00</b>

**Total de renta variable** **66.465** **4,07**

**Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario** **66.465** **4,07**

**Valor total de las inversiones** **81.391** **4,98**

(Coste total: 605.935 USD)

\* Consulte la nota 1.

\*\* Título a su valor razonable.

## Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha

### Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2021

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>			
<b>Renta variable</b>				<b>Renta variable (continuación)</b>			
<b>SUIZA</b>				<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>			
2.998	TE Connectivity Limited	411.386	1,79	2.642	Zoetis Inc.	512.918	2,24
<b>Total de Suiza</b>		<b>411.386</b>	<b>1,79</b>	<b>Total de Estados Unidos</b>		<b>18.991.454</b>	<b>82,86</b>
<b>ESTADOS UNIDOS</b>				<b>Total de renta variable</b>			
1.611	Adobe Systems Inc.	927.485	4,05	<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>			
1.432	Agco Corp.	175.463	0,77	<b>19.402.840</b>			
391	Alphabet Inc. - A	1.045.346	4,56	<b>84,65</b>			
227	Amazon.com Inc.	745.704	3,25	<b>Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>			
4.873	American Electric Power Company Inc.	395.590	1,73	<b>Fondos</b>			
1.221	Aspen Technology Inc.	149.939	0,65	<b>IRLANDA</b>			
14.009	Bank of America Corp.	594.682	2,59	1.025.416	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	1.025.416	4,47
10.470	Centene Corp.	652.386	2,85	<b>Total de Irlanda</b>			
15.168	Cisco Systems Inc.	825.594	3,60	<b>1.025.416</b>			
9.417	Coca Cola Company	494.110	2,16	<b>Total de fondos</b>			
7.866	CVS Health Corp.	667.509	2,91	<b>1.025.416</b>			
2.541	Doximity Inc.	205.059	0,89	<b>Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>			
2.381	DuPont de Nemours Inc.	161.884	0,71	<b>1.025.416</b>			
9.105	Electronic Arts Inc.	1.295.185	5,66	<b>Valor total de las inversiones</b>			
1.628	Estee Lauder Companies Inc.	488.286	2,13	<b>20.428.256</b>			
453	Fair Isaac Corp.	180.262	0,79	<b>(Coste total: 18.716.539 USD)</b>			
3.357	Hilton Worldwide Holdings Inc.	443.493	1,93				
7.486	Kontoor Brands Inc.	373.926	1,63				
650	Lam Research Corp.	369.948	1,61				
9.081	Livent Corp.	209.862	0,92				
2.319	Mastercard Inc. - A	806.270	3,51				
2.013	Mirati Therapeutics Inc.	356.120	1,55				
9.274	Morgan Stanley	902.453	3,95				
2.619	nCino Inc.	186.028	0,81				
1.557	Paypal Holdings Inc.	405.147	1,77				
9.280	Renewable Energy Group Inc.	465.856	2,03				
3.278	Salesforce.com Inc.	889.059	3,88				
3.550	Schnitzer Steel Industries Inc.	155.526	0,68				
3.281	State Street Corp.	277.966	1,21				
727	Svb Financial Group	470.282	2,05				
3.219	Target Corp.	736.410	3,21				
1.493	Teradata Corp.	85.624	0,37				
1.546	TransUnion	173.631	0,76				
2.691	Union Pacific Corp.	527.463	2,30				
3.880	United Parcel Service Inc.	706.548	3,08				
2.700	Vertex Pharmaceuticals Inc.	489.753	2,14				
4.002	VF Corp.	268.094	1,17				
2.844	Voya Financial Inc.	174.593	0,76				

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			
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>						
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>						
<b>ALEMANIA (continuación)</b>				<b>ALEMANIA (continuación)</b>						
EUR	1.200.000	Adler Real Estate AG 3.00% 27/04/2026	1.056.668	0,09	EUR	5.223.000	Thyssenkrupp AG 1.38% 03/03/2022	5.228.154	0,44	
EUR	4.200.000	alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	4.232.841	0,36	<b>Total de Alemania</b>				<b>110.938.923</b>	<b>9,41</b>
EUR	4.700.000	Amprion GmbH 0.63% 23/09/2033	4.597.070	0,39	<b>INDIA</b>					
EUR	2.700.000	Bayer AG 1.00% 12/01/2036	2.537.607	0,22	USD	3.630.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029	3.278.262	0,28	
EUR	3.590.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.50% 11/02/2027	3.637.646	0,31	USD	8.251.000	GMR Hyderabad International Airport Limited 4.25% 27/10/2027	6.838.551	0,58	
EUR	9.228.000	Commerzbank AG 0.50% 04/12/2026	9.365.670	0,79	<b>Total de India</b>				<b>10.116.813</b>	<b>0,86</b>
EUR	1.508.000	Commerzbank AG 1.00% 04/03/2026	1.565.964	0,13	<b>IRLANDA</b>					
EUR	5.600.000	Commerzbank AG FRN 05/12/2030	6.185.716	0,53	EUR	4.767.000	AIB Group plc FRN 19/11/2029	4.918.105	0,42	
EUR	9.699.000	Deutsche Bank AG FRN 10/06/2026	10.175.692	0,86	EUR	1.275.000	AIB Group plc FRN 30/05/2031	1.369.840	0,12	
EUR	1.500.000	Deutsche Bank AG FRN 19/11/2030	1.580.885	0,13	EUR	1.181.000	AIB Group plc Perp FRN	1.319.543	0,11	
EUR	1.900.000	Deutsche Lufthansa AG 3.50% 14/07/2029	1.966.131	0,17	EUR	3.710.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	3.713.462	0,32	
EUR	1.800.000	Deutsche Lufthansa AG 3.75% 11/02/2028	1.894.931	0,16	EUR	4.627.000	Eaton Capital Unlimi 0.58% 08/03/2030	4.629.571	0,39	
EUR	1.381.000	Gruenthal GmbH 3.63% 15/11/2026	1.434.742	0,12	EUR	7.369.000	Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	7.538.506	0,65	
EUR	1.215.000	Gruenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	1.274.949	0,11	USD	3.060.000	GE Capital International Funding Company 4.42% 15/11/2035	3.170.989	0,27	
EUR	1.327.000	Gruenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	1.392.475	0,12	<b>Total de Irlanda</b>				<b>26.660.016</b>	<b>2,28</b>
EUR	3.687.000	HT Troplast AG 9.25% 15/07/2025	4.053.817	0,34	<b>ITALIA</b>					
EUR	3.302.000	Ineos Styrolution Group GmbH 2.25% 16/01/2027	3.276.012	0,28	EUR	2.287.000	Aeroporti di Roma SpA 1.63% 08/06/2027	2.398.034	0,20	
EUR	2.288.000	K+S AG 4.13% 06/12/2021	2.301.061	0,20	EUR	932.000	Aeroporti di Roma SpA 1.75% 30/07/2031	967.914	0,08	
EUR	4.800.000	Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	4.735.261	0,40	EUR	1.915.000	Atlantia SpA 1.88% 12/02/2028	1.997.003	0,17	
EUR	4.481.000	Novelis Sheet Ingot GmbH 3.38% 15/04/2029	4.681.805	0,40	EUR	815.000	Autostrade per l'Italia 2.00% 04/12/2028	857.772	0,07	
EUR	5.555.000	PCF GmbH 4.75% 15/04/2026	5.749.024	0,48	EUR	490.000	Autostrade per l'Italia 2.00% 15/01/2030	515.324	0,04	
EUR	2.610.000	Peach Property Finance GmbH 3.50% 15/02/2023	2.647.639	0,22	EUR	995.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.88% 26/09/2029	1.040.612	0,09	
EUR	3.240.000	Peach Property Finance GmbH 4.38% 15/11/2025	3.347.212	0,28	EUR	2.328.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1.88% 09/01/2026	2.343.246	0,20	
EUR	5.100.000	Schaeffler AG 3.38% 12/10/2028	5.719.592	0,49	EUR	3.870.000	Banco BPM SpA 1.75% 24/04/2023	3.970.298	0,34	
EUR	3.512.000	Schenck Process Holding GmbH/Darmstadt 5.38% 15/06/2023	3.544.769	0,30	EUR	11.599.000	Banco BPM SpA 2.00% 08/03/2022	11.703.571	0,99	
EUR	5.576.000	SGL Carbon SE 4.63% 30/09/2024	5.692.037	0,48	EUR	1.556.000	Eni SpA Perp FRN	1.580.416	0,13	

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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>ITALIA (continuación)</b>				<b>LUXEMBURGO (continuación)</b>					
EUR	1.673.000	Lkq Italia Bondco 3.88% 01/04/2024	1.806.500	0,15	EUR	2.834.000	Cirsa Finance International Sarl 4.50% 15/03/2027	2.811.113	0,24
EUR	1.481.000	Nexi SpA 1.63% 30/04/2026	1.488.353	0,13	EUR	2.117.831	Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	2.154.169	0,18
EUR	5.163.000	Nexi SpA 1.75% 31/10/2024	5.290.061	0,45	EUR	4.477.000	Crystal Almond Sarl 4.25% 15/10/2024	4.582.778	0,39
EUR	1.481.000	Nexi SpA 2.13% 30/04/2029	1.480.331	0,13	EUR	1.331.000	Garfunkelux Holdingco 3 SA 6.75% 01/11/2025	1.393.189	0,12
EUR	6.492.000	Rossini Sarl 6.75% 30/10/2025	6.743.536	0,57	GBP	2.120.000	Garfunkelux Holdingco 3 SA 7.75% 01/11/2025	2.583.782	0,22
EUR	650.000	Telecom Italia SpA 5.25% 10/02/2022	662.360	0,06	EUR	2.679.000	Groupe Ecore Holding SAS FRN 15/11/2023	2.726.758	0,23
	<b>Total de Italia</b>		<b>44.845.331</b>	<b>3,80</b>	EUR	5.083.000	InPost SA 2.25% 15/07/2027	5.143.574	0,44
<b>JERSEY - ISLAS DEL CANAL</b>				<b>PAÍSES BAJOS</b>					
EUR	5.384.000	Adient Global Holdings Limited 3.50% 15/08/2024	5.437.296	0,46	EUR	2.625.000	Kleopatra Finco Sarl 4.25% 01/03/2026	2.577.092	0,22
EUR	3.400.000	Avis Budget Finance plc 4.13% 15/11/2024	3.458.310	0,29	EUR	3.689.000	Novartis Finance SA 0.00% 23/09/2028	3.638.582	0,31
USD	5.272.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 1.75% 30/09/2027	4.602.878	0,39	EUR	994.000	Picard Bondco SA 5.38% 01/07/2027	1.004.497	0,09
USD	5.558.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.16% 31/03/2034	4.723.785	0,40	EUR	3.146.000	Sani/Ikos Financial Holdings 1 Sarl 5.63% 15/12/2026	3.220.234	0,27
GBP	2.355.000	Hastings Group Finance plc 3.00% 24/05/2025	2.891.534	0,25		<b>Total de Luxemburgo</b>	<b>71.236.163</b>	<b>6,05</b>	
EUR	1.542.000	Heathrow Funding Limited 1.13% 08/10/2030	1.534.764	0,13					
	<b>Total de Jersey - Islas del Canal</b>		<b>22.648.567</b>	<b>1,92</b>	EUR	1.791.000	Akelius Residential Property Financing BV 1.13% 11/01/2029	1.825.701	0,15
<b>LUXEMBURGO</b>				EUR	2.848.000	Ashland Services BV 2.00% 30/01/2028	2.949.053	0,25	
EUR	1.700.000	Adler Group SA 2.75% 13/11/2026	1.467.560	0,12	EUR	7.200.000	Cooperatieve Rabobank UA Perp FRN	8.010.050	0,68
EUR	4.100.000	Adler Group SA 3.25% 05/08/2025	3.634.824	0,31	EUR	5.000.000	Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	5.096.933	0,43
EUR	5.159.000	Altice Financing SA 3.00% 15/01/2028	4.882.672	0,42	EUR	4.453.000	Diebold Nixdorf Dutch Holding BV 9.00% 15/07/2025	4.848.884	0,41
EUR	1.236.000	Altice Financing SA 4.25% 15/08/2029	1.215.524	0,10	GBP	2.900.000	E.ON International Finance BV 6.25% 03/06/2030	4.494.717	0,38
EUR	6.994.000	Altice France Holding SA 8.00% 15/05/2027	7.461.751	0,63	EUR	1.908.000	Goodyear Europe BV 2.75% 15/08/2028	1.927.010	0,16
EUR	3.900.000	Aroundtown SA 1.45% 09/07/2028	4.080.933	0,35	EUR	4.100.000	Iberdrola International BV Perp FRN	4.122.504	0,35
GBP	1.855.000	Aroundtown SA 3.00% 16/10/2029	2.294.158	0,19	USD	10.000.000	ING Groep NV Perp FRN	9.463.495	0,80
EUR	6.180.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 04/06/2026	6.451.856	0,55	EUR	4.078.000	Nobel Bidco BV 3.13% 15/06/2028	4.061.541	0,34
EUR	1.778.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 12/02/2036	1.758.868	0,15	EUR	6.681.000	Oci NV 3.13% 01/11/2024	6.792.967	0,58
EUR	1.876.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.34% 13/08/2041	1.808.032	0,15	EUR	3.020.000	Stedin Holding NV Perp FRN	3.077.063	0,26
EUR	4.249.000	Canpack SA 2.38% 01/11/2027	4.344.217	0,37	EUR	3.140.000	Stichting AK Rabobank Certificaten Perp 2.19%	4.520.767	0,38
					EUR	4.646.324	Summer Bidco BV 9.00% 15/11/2025	4.761.310	0,40

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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>PAÍSES BAJOS (continuación)</b>				<b>SUIZA (continuación)</b>					
EUR	1.500.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	1.463.431	0,12	EUR	3.200.000	Credit Suisse Group AG 0.63% 18/01/2033	3.017.930	0,26
EUR	5.700.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	6.194.564	0,54	USD	4.500.000	Credit Suisse Group AG Perp FRN	4.249.526	0,36
EUR	3.758.000	Tennet Holding BV Perp FRN	3.945.170	0,33	EUR	3.238.000	UBS AG 0.50% 31/03/2031	3.210.283	0,27
EUR	5.221.000	Tennet Holding BV Perp FRN	5.513.486	0,47	USD	6.600.000	UBS Group AG Perp FRN	6.498.077	0,56
EUR	1.751.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 3.25% 15/04/2022	1.760.823	0,15	USD	3.906.000	UBS Group Funding Switzerland AG Perp FRN	3.677.326	0,31
EUR	500.000	United Group BV 4.88% 01/07/2024	507.030	0,04			<b>Total de Suiza</b>	<b>23.166.582</b>	<b>1,97</b>
EUR	1.000.000	Volkswagen International Finance NV 4.13% 16/11/2038	1.383.310	0,12					
		<b>Total de Países Bajos</b>	<b>86.719.809</b>	<b>7,34</b>					
<b>NORUEGA</b>				<b>REINO UNIDO</b>					
EUR	3.475.000	DNB Bank ASA FRN 23/02/2029	3.429.359	0,29	GBP	6.845.000	Barclays Bank plc 5.75% 14/09/2026	9.536.016	0,81
		<b>Total de Noruega</b>	<b>3.429.359</b>	<b>0,29</b>	EUR	2.300.000	Barclays plc FRN 12/05/2032	2.316.911	0,20
<b>ESPAÑA</b>				GBP 3.100.000 Barclays plc Perp FRN 3.984.137 0,34					
EUR	2.400.000	Caixabank SA 0.38% 03/02/2025	2.432.342	0,21	GBP	3.478.000	Boparan Finance plc 7.63% 30/11/2025	3.582.610	0,30
EUR	4.700.000	Caixabank SA 1.13% 17/05/2024	4.856.000	0,41	USD	6.633.000	Bp Capital Markets plc Perp FRN	6.109.292	0,53
EUR	4.216.000	Gestamp Automocion SA 3.25% 30/04/2026	4.267.828	0,36	EUR	2.968.000	British American Tobacco plc Perp 3.00%	2.945.975	0,25
EUR	4.349.000	Grifols Escrow Issuer SA 3.88% 15/10/2028	4.405.480	0,37	GBP	406.500	Broadgate Financing plc 5.10% 05/04/2033	557.559	0,05
EUR	2.902.000	Grifols SA 3.20% 01/05/2025	2.915.676	0,25	EUR	5.038.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	5.038.751	0,43
EUR	1.242.000	Nortegas Energía Distribucion SAU 2.07% 28/09/2027	1.341.978	0,11	GBP	3.679.000	Deuce Finco plc 5.50% 15/06/2027	4.341.593	0,37
		<b>Total de España</b>	<b>20.219.304</b>	<b>1,71</b>	GBP	2.302.000	Ds Smith plc 2.88% 26/07/2029	2.795.839	0,24
<b>SUECIA</b>				EUR 6.677.000 EC Finance plc 2.38% 15/11/2022 6.713.941 0,57					
EUR	1.748.000	Heimstaden Bostad AB Perp FRN	1.731.332	0,15	EUR	3.308.000	EC Finance plc 3.00% 15/10/2026	3.334.557	0,28
EUR	4.034.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	4.146.108	0,36	USD	2.176.559	Enquest plc 7.00% 15/04/2022	1.813.486	0,15
EUR	3.862.000	Sagax AB 2.00% 17/01/2024	4.020.600	0,34	EUR	2.710.000	FCE Bank plc 1.13% 10/02/2022	2.720.524	0,23
EUR	2.449.000	Verisure Holding AB 3.25% 15/02/2027	2.466.342	0,21	GBP	200.000	FCE Bank plc 2.73% 03/06/2022	235.563	0,02
EUR	1.950.000	Verisure Holding AB 3.25% 15/02/2027	1.963.808	0,17	GBP	3.919.000	GKN Holdings plc 5.38% 19/09/2022	4.737.462	0,40
EUR	7.682.000	Verisure Holding AB 3.50% 15/05/2023	7.757.693	0,65	EUR	6.500.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	7.395.868	0,63
EUR	1.832.000	Volvo Car AB 2.50% 07/10/2027	2.000.770	0,17	GBP	2.920.000	HSBC Bank plc 5.38% 22/08/2033	4.426.877	0,38
		<b>Total de Suecia</b>	<b>24.086.653</b>	<b>2,05</b>	GBP	9.150.000	HSBC Holdings plc Perp FRN	11.706.469	0,99
<b>SUIZA</b>				GBP 3.848.000 Iceland Bondco plc 4.63% 15/03/2025 4.181.036 0,35					
EUR	2.571.000	Credit Suisse AG 0.25% 01/09/2028	2.513.440	0,21	EUR	1.840.000	Imperial Brands Finance plc 3.38% 26/02/2026	2.063.533	0,18
					EUR	2.495.000	Ineos Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	2.523.810	0,21
					GBP	2.437.000	Inspired Entertainment Financing plc 7.88% 01/06/2026	2.920.342	0,25
					EUR	3.189.000	International Game Technology plc 3.50% 15/07/2024	3.357.709	0,29

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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>REINO UNIDO (continuación)</b>				<b>REINO UNIDO (continuación)</b>					
GBP	500.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 3.88% 01/03/2023	588.842	0,05	GBP	776.000	Pinnacle Bidco plc 6.38% 15/02/2025	922.834	0,08
EUR	1.548.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 4.50% 15/07/2028	1.529.477	0,13	GBP	3.864.000	Punch Finance plc 6.13% 30/06/2026	4.609.920	0,40
GBP	2.117.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 5.00% 15/02/2022	2.494.105	0,21	GBP	3.100.000	Santander UK plc Perp 10.06%	6.433.298	0,55
GBP	2.344.000	Ladbrokes Group Finance plc 5.13% 16/09/2022	2.844.398	0,24	USD	12.875.000	SSE plc FRN 16/09/2077	11.356.497	0,96
GBP	2.166.000	Legal & General Group plc FRN 26/11/2049	2.681.853	0,23	EUR	3.191.000	Synthomer plc 3.88% 01/07/2025	3.308.061	0,28
GBP	836.000	Legal & General Group plc FRN 01/11/2050	1.093.691	0,09	GBP	2.864.000	Telereal Securitisation plc FRN 10/12/2033	3.367.458	0,29
GBP	7.133.000	Lloyds Banking Group plc Perp FRN	8.727.477	0,74	GBP	1.761.585	Telereal Securitisation plc 5.43% 10/12/2031	2.457.781	0,21
GBP	12.060.000	Lloyds TSB Bank plc 7.63% 22/04/2025	17.123.915	1,45	GBP	5.655.588	Tesco Property Finance 3 plc 5.74% 13/04/2040	8.635.061	0,73
GBP	1.100.000	M&G plc FRN 20/10/2051	1.514.784	0,13	GBP	2.020.599	Tesco Property Finance 5 plc 5.66% 13/10/2041	3.082.101	0,26
GBP	2.587.000	Marks & Spencer plc 6.13% 06/12/2021	3.044.183	0,26	GBP	1.940.000	Thames Water Kemble Finance plc 4.63% 19/05/2026	2.360.983	0,20
GBP	1.099.113	Marston's Issuer plc FRN 15/10/2027	1.192.883	0,10	GBP	2.500.000	Thames Water Utilities Finance plc FRN 13/09/2030	3.026.852	0,26
GBP	1.531.809	Mitchells & Butlers Finance plc 5.57% 15/12/2030	2.022.314	0,17	GBP	2.071.000	Travis Perkins plc 3.75% 17/02/2026	2.565.547	0,22
GBP	145.055	Mitchells & Butlers Finance plc 5.97% 15/12/2023	176.268	0,01	GBP	1.320.000	Travis Perkins plc 4.50% 07/09/2023	1.631.956	0,14
GBP	553.072	Mitchells & Butlers Finance plc 6.01% 15/12/2030	706.883	0,06	EUR	2.040.000	Victoria plc 3.63% 26/08/2026	2.091.521	0,18
EUR	2.931.000	Modulaire Global Finance plc FRN 15/02/2023	2.948.439	0,25	EUR	1.922.000	Vmed O2 UK Financing I plc 3.25% 31/01/2031	1.977.635	0,17
EUR	178.000	Modulaire Global Finance plc 6.50% 15/02/2023	181.362	0,02	GBP	2.767.000	Vmed O2 UK Financing I plc 4.00% 31/01/2029	3.254.444	0,28
EUR	4.000.000	Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	3.968.723	0,34	EUR	2.698.000	Vodafone Group plc FRN 27/08/2080	2.796.275	0,24
EUR	2.223.000	Natwest Group plc FRN 26/02/2030	2.222.923	0,19	USD	3.500.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	3.324.761	0,28
EUR	1.856.000	NatWest Group plc 1.04% 14/09/2032	1.850.753	0,16	GBP	7.100.000	Western Power Distribution plc 3.50% 16/10/2026	9.035.713	0,77
GBP	1.639.000	NatWest Group plc FRN 28/11/2031	1.907.729	0,16	GBP	1.444.000	WM Morrison Supermarkets plc 4.63% 08/12/2023	1.783.992	0,15
GBP	3.355.000	NatWest Group plc FRN 19/09/2026	4.106.399	0,35	<b>Total del Reino Unido</b>		<b>259.568.470</b>	<b>22,08</b>	
USD	1.500.000	NatWest Group plc FRN 08/05/2030	1.481.355	0,13	<b>ESTADOS UNIDOS</b>				
GBP	3.901.000	Natwest Group plc Perp FRN	4.880.062	0,41	USD	4.056.000	AbbVie Inc. 4.25% 21/11/2049	4.135.443	0,35
EUR	4.686.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	4.779.251	0,41	GBP	5.250.000	American International Group Inc. 5.00% 26/04/2023	6.513.139	0,55
GBP	5.715.000	Ocado Group plc 4.00% 15/06/2024	6.717.153	0,57	USD	2.140.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc. 5.45% 23/01/2039	2.391.640	0,20
EUR	1.378.000	Pinnacle Bidco plc 5.50% 15/02/2025	1.420.698	0,12	EUR	2.174.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 2.00% 01/09/2028	2.196.176	0,19

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.



## Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

### Estado de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>				<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>					
EUR	3.468.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 3.00% 01/09/2029	3.482.238	0,30	EUR	1.375.000	Southern Company 1.88% 15/09/2081	1.369.141	0,12
USD	3.073.000	AT&T Inc. 2.55% 01/12/2033	2.612.514	0,22	USD	3.000.000	Teva Pharmaceutical Finance BV 3.65% 10/11/2021	2.591.203	0,22
USD	1.375.000	AT&T Inc. 4.30% 15/12/2042	1.335.791	0,11	GBP	3.925.000	Time Warner Cable Inc. 5.75% 02/06/2031	5.796.673	0,49
EUR	2.420.000	Bank of America Corp. FRN 24/05/2032	2.480.290	0,21	USD	2.745.000	Verizon Communications Inc. 2.55% 21/03/2031	2.400.316	0,20
USD	6.417.000	Bank of America Corp. FRN 22/04/2032	5.651.650	0,48			<b>Total de Estados Unidos</b>	<b>127.754.687</b>	<b>10,82</b>
EUR	14.575.000	Becton Dickinson and Company 1.40% 24/05/2023	14.946.469	1,27			<b>Total de bonos</b>	<b>977.206.222</b>	<b>82,95</b>
EUR	2.845.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 2.38% 01/03/2028	2.885.771	0,24	<b>Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda</b>				
EUR	5.214.000	Digital Euro Finco LLC 1.13% 09/04/2028	5.369.564	0,46	<b>ALEMANIA</b>				
EUR	1.233.000	Eli Lilly & Company 1.38% 14/09/2061	1.159.135	0,10	GBP	11.400.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.88% 15/09/2026	13.328.223	1,13
EUR	3.943.000	Fidelity National Information Services Inc. 1.00% 03/12/2028	4.063.607	0,34			<b>Total de Alemania</b>	<b>13.328.223</b>	<b>1,13</b>
EUR	3.073.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.25% 15/09/2025	3.280.242	0,28	<b>Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda</b>				
EUR	2.526.000	General Electric Company 2.13% 17/05/2037	2.760.023	0,23			<b>13.328.223</b>	<b>1,13</b>	
USD	1.179.000	Goodman USA Finance Three LLC 3.70% 15/03/2028	1.102.932	0,09	<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				
EUR	3.763.000	Iqvia Inc. 2.25% 15/01/2028	3.795.122	0,32			<b>990.534.445</b>	<b>84,08</b>	
EUR	3.334.000	Iqvia Inc. 2.88% 15/06/2028	3.433.418	0,29	<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente</b>				
USD	4.829.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2032	4.225.270	0,36	<b>Bonos</b>				
EUR	1.432.000	Kraft Heinz Foods Company 2.25% 25/05/2028	1.559.689	0,13	<b>AUSTRALIA</b>				
GBP	5.498.000	Kraft Heinz Foods Company 4.13% 01/07/2027	7.136.093	0,62	USD	9.082.000	APT Pipelines Limited 4.25% 15/07/2027	8.898.795	0,76
EUR	1.983.000	Netflix Inc. 3.00% 15/06/2025	2.157.502	0,18	USD	3.640.000	Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	3.525.978	0,30
EUR	600.000	Netflix Inc. 3.63% 15/05/2027	694.495	0,06			<b>Total de Australia</b>	<b>12.424.773</b>	<b>1,06</b>
EUR	4.000.000	Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	4.849.364	0,41	<b>BERMUDAS</b>				
EUR	640.000	Netflix Inc. 4.63% 15/05/2029	803.795	0,07	USD	10.281.000	Bacardi Limited 4.45% 15/05/2025	9.779.936	0,83
EUR	2.825.000	Olympus Water USA 3.88% 01/10/2028	2.831.971	0,24	USD	11.721.000	Bacardi Limited 4.70% 15/05/2028	11.717.383	1,00
EUR	1.565.000	Olympus Water USA 5.38% 01/10/2029	1.549.677	0,13			<b>Total de Bermudas</b>	<b>21.497.319</b>	<b>1,83</b>
USD	2.270.000	Oracle Corp. 3.65% 25/03/2041	2.031.885	0,17					
USD	2.478.000	Plains All American Pipeline LP 3.55% 15/12/2029	2.249.575	0,19					
EUR	2.176.000	Scientific Games International Inc. 5.50% 15/02/2026	2.249.751	0,19					
EUR	2.284.000	Silgan Holdings Inc. 2.25% 01/06/2028	2.303.544	0,20					
EUR	7.294.000	Silgan Holdings Inc. 3.25% 15/03/2025	7.359.579	0,61					

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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)</b>				<b>Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario (continuación)</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>FRANCIA</b>				<b>REINO UNIDO</b>					
USD	6.211.000	BPCE SA 2.70% 01/10/2029	5.563.566	0,47	GBP	3.817.000	Miller Homes Group Holdings plc 5.50% 15/10/2024	4.505.930	0,38
		<b>Total de Francia</b>	<b>5.563.566</b>	<b>0,47</b>	EUR	1.434.000	Modulaire Global Finance plc 6.50% 15/02/2023	1.461.085	0,12
<b>PAÍSES BAJOS</b>				<b>GBP</b>					
USD	3.856.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	3.593.463	0,31	1.490.000	Talktalk Telecom Group plc 3.88% 20/02/2025	1.703.137	0,14	
		<b>Total de Países Bajos</b>	<b>3.593.463</b>	<b>0,31</b>		<b>Total del Reino Unido</b>	<b>7.670.152</b>	<b>0,64</b>	
<b>REINO UNIDO</b>				<b>Total de bonos</b>					
GBP	3.936.000	Bellis Acquisition Company 3.25% 16/02/2026	4.512.271	0,38			<b>11.441.808</b>	<b>0,96</b>	
GBP	5.119.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	6.045.924	0,51	<b>Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario</b>				
		<b>Total del Reino Unido</b>	<b>10.558.195</b>	<b>0,89</b>			<b>11.441.808</b>	<b>0,96</b>	
<b>ESTADOS UNIDOS</b>				<b>Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>					
USD	4.470.000	Carrier Global Corp. 2.72% 15/02/2030	3.989.880	0,34	<b>Fondos</b>				
USD	2.819.000	Jersey Central Power & Light Company 2.75% 01/03/2032	2.493.241	0,21	<b>IRLANDA</b>				
		<b>Total de Estados Unidos</b>	<b>6.483.121</b>	<b>0,55</b>	6.527.800	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	7.594.599	0,64	
<b>Total de bonos</b>				<b>60.120.437</b>	<b>5,11</b>	15.559.517	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	13.425.530	1,14
<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente</b>				<b>60.120.437</b>	<b>5,11</b>	216.197	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	21.309.538	1,82
<b>Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario</b>				<b>Total de Irlanda</b>					
<b>Bonos</b>				<b>32.435</b>					
<b>DINAMARCA</b>				<b>Insight Liquidity Funds plc</b>					
USD	2.205.000	Danske Bank AS 1.55% 10/09/2027	1.890.656	0,16		<b>Total de Irlanda</b>	<b>42.367.403</b>	<b>3,60</b>	
		<b>Total de Dinamarca</b>	<b>1.890.656</b>	<b>0,16</b>	<b>Total de fondos</b>				
<b>PORTUGAL</b>				<b>42.367.403</b>					
EUR	17.100.000	Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2022	1.881.000	0,16	<b>Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>				
		<b>Total de Portugal</b>	<b>1.881.000</b>	<b>0,16</b>	<b>42.367.403</b>				
<b>Valor total de las inversiones</b>				<b>1.104.464.093</b>					
<b>(Coste total: 1.079.305.115 EUR)</b>				<b>93,75</b>					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities

### Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2021

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo			
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>						
<b>Bonos</b>				<b>Bonos (continuación)</b>						
<b>AUSTRALIA</b>				<b>DINAMARCA</b>						
EUR	274.000	APT Pipelines Limited 1.25% 15/03/2033	272.555	0,49	EUR	441.000	Danske Bank AS 0.63% 26/05/2025	451.069	0,81	
USD	144.000	APT Pipelines Limited 4.25% 15/07/2027	141.095	0,25	EUR	100.000	Danske Bank AS FRN 15/05/2031	100.479	0,18	
EUR	122.000	Aurizon Network Pty Limited 3.13% 01/06/2026	137.961	0,25	<b>Total de Dinamarca</b>					
EUR	100.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031	99.805	0,18	<b>551.548 0,99</b>					
EUR	220.000	Ausgrid Finance Pty Limited 1.25% 30/07/2025	229.051	0,41	<b>FINLANDIA</b>					
EUR	228.000	AusNet Services Holdings Pty Ltd 0.63% 25/08/2030	225.990	0,41	EUR	243.000	Nordea Bank Abp 0.50% 14/05/2027	249.108	0,45	
EUR	196.000	Goodman Australia 1.38% 27/09/2025	204.869	0,37	EUR	643.000	OP Corporate Bank plc 0.10% 16/11/2027	639.579	1,15	
GBP	210.000	Pacific National Finance Pty Limited 5.00% 19/09/2023	260.960	0,47	<b>Total de Finlandia</b>					
USD	400.000	SGSP Australia Assets Pty Limited 3.25% 29/07/2026	371.225	0,67	<b>888.687 1,60</b>					
<b>Total de Australia</b>				<b>1.943.511</b>	<b>3,50</b>	<b>FRANCIA</b>				
<b>BÉLGICA</b>				<b>FRANCIA</b>						
EUR	188.000	Anheuser-Busch InBev SA/ NV 3.70% 02/04/2040	252.378	0,45	EUR	600.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.25% 29/06/2028	598.600	1,07	
EUR	300.000	Belfius Bank SA 0.00% 28/08/2026	298.540	0,54	GBP	200.000	BNP Paribas SA FRN 24/05/2031	232.684	0,42	
EUR	200.000	Belfius Bank SA 0.13% 08/02/2028	197.930	0,35	EUR	500.000	Credit Agricole SA 1.00% 03/07/2029	526.556	0,94	
EUR	400.000	Kbc Group NV Perp FRN	423.756	0,76	USD	400.000	Credit Agricole SA Perp FRN	383.887	0,69	
<b>Total de Bélgica</b>				<b>1.172.604</b>	<b>2,10</b>	EUR	100.000	Electricite de France SA 2.00% 09/12/2049	106.271	0,19
<b>BERMUDAS</b>				<b>FRANCIA</b>						
EUR	822.000	Bacardi Limited 2.75% 03/07/2023	862.239	1,54	EUR	200.000	Electricite de France SA Perp FRN	210.920	0,38	
<b>Total de Bermudas</b>				<b>862.239</b>	<b>1,54</b>	EUR	141.000	Faurecia 2.38% 15/06/2029	142.750	0,26
<b>ISLAS CAIMÁN</b>				<b>FRANCIA</b>						
GBP	960.000	Southern Water Services Finance Limited 2.38% 28/05/2028	1.155.673	2,07	EUR	144.000	RCI Banque SA 2.00% 11/07/2024	151.043	0,27	
USD	200.000	Tencent Holdings Limited 2.88% 22/04/2031	176.440	0,32	EUR	500.000	Sanef SA 1.88% 16/03/2026	535.566	0,95	
USD	555.000	Tencent Holdings Limited 3.60% 19/01/2028	513.145	0,92	<b>Total de Francia</b>					
GBP	100.000	Thames Water Utilities Finance plc 2.38% 03/05/2023	117.821	0,21	<b>2.888.277 5,17</b>					
<b>Total de Islas Caimán</b>				<b>1.963.079</b>	<b>3,52</b>	<b>ALEMANIA</b>				
<b>ISLAS CAIMÁN</b>				<b>ALEMANIA</b>						
GBP	960.000	Southern Water Services Finance Limited 2.38% 28/05/2028	1.155.673	2,07	EUR	300.000	alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	302.346	0,54	
USD	200.000	Tencent Holdings Limited 2.88% 22/04/2031	176.440	0,32	EUR	400.000	Amprion GmbH 0.63% 23/09/2033	391.240	0,70	
USD	555.000	Tencent Holdings Limited 3.60% 19/01/2028	513.145	0,92	EUR	200.000	Bayer AG 1.00% 12/01/2036	187.971	0,34	
GBP	100.000	Thames Water Utilities Finance plc 2.38% 03/05/2023	117.821	0,21	EUR	396.000	Commerzbank AG 0.50% 04/12/2026	401.908	0,72	
<b>Total de Islas Caimán</b>				<b>1.963.079</b>	<b>3,52</b>	EUR	181.000	Commerzbank AG 1.00% 04/03/2026	187.957	0,34
<b>ISLAS CAIMÁN</b>				<b>ALEMANIA</b>						
GBP	960.000	Southern Water Services Finance Limited 2.38% 28/05/2028	1.155.673	2,07	EUR	400.000	Commerzbank AG FRN 05/12/2030	441.837	0,79	
USD	200.000	Tencent Holdings Limited 2.88% 22/04/2031	176.440	0,32	EUR	845.000	Deutsche Bank AG FRN 10/06/2026	886.531	1,59	
USD	555.000	Tencent Holdings Limited 3.60% 19/01/2028	513.145	0,92	EUR	100.000	Deutsche Bank AG FRN 19/11/2030	105.392	0,19	
GBP	100.000	Thames Water Utilities Finance plc 2.38% 03/05/2023	117.821	0,21	<b>Total de Alemania</b>					
<b>Total de Islas Caimán</b>				<b>1.963.079</b>	<b>3,52</b>	<b>1.963.079 3,52</b>				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade 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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>					
<b>ALEMANIA (continuación)</b>				<b>JERSEY - ISLAS DEL CANAL (continuación)</b>					
EUR	500.000	Hamburg Commercial Bank AG 0.38% 09/03/2026	501.179	0,90	EUR	136.000	Heathrow Funding Limited 1.13% 08/10/2030	135.362	0,24
EUR	160.000	Volkswagen Financial Services AG 0.13% 12/02/2027	157.829	0,28			<b>Total de Jersey - Islas del Canal</b>	<b>1.324.699</b>	<b>2,37</b>
EUR	250.000	Volkswagen Leasing GmbH 0.38% 20/07/2026	250.634	0,45					
		<b>Total de Alemania</b>	<b>3.814.824</b>	<b>6,84</b>					
<b>INDIA</b>				<b>LUXEMBURGO</b>					
USD	334.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029	301.636	0,54	EUR	200.000	Aroundtown SA 0.00% 16/07/2026	196.829	0,35
		<b>Total de India</b>	<b>301.636</b>	<b>0,54</b>	EUR	300.000	Aroundtown SA 1.45% 09/07/2028	313.918	0,56
					GBP	100.000	Aroundtown SA 3.00% 16/10/2029	123.674	0,22
<b>IRLANDA</b>				<b>MÉXICO</b>					
EUR	396.000	AIB Group plc FRN 19/11/2029	408.552	0,73	EUR	1.006.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 04/06/2026	1.050.253	1,88
EUR	125.000	AIB Group plc FRN 30/05/2031	134.298	0,24	EUR	115.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 12/02/2036	113.763	0,20
EUR	290.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	290.271	0,52	EUR	138.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.34% 13/08/2041	133.000	0,24
EUR	460.000	Eaton Capital Unlimi 0.58% 08/03/2030	460.256	0,83	EUR	255.000	Medtronic Global Holdings SCA 1.38% 15/10/2040	259.079	0,47
USD	400.000	GE Capital International Funding Company 4.42% 15/11/2035	414.508	0,74	EUR	318.000	Novartis Finance SA 0.00% 23/09/2028	313.654	0,56
		<b>Total de Irlanda</b>	<b>1.707.885</b>	<b>3,06</b>			<b>Total de Luxemburgo</b>	<b>2.504.170</b>	<b>4,48</b>
<b>ITALIA</b>				<b>PAÍSES BAJOS</b>					
EUR	111.000	Aeroporti di Roma SpA 1.63% 08/06/2027	116.389	0,21	EUR	188.000	Akelius Residential Property Financing BV 1.13% 11/01/2029	191.643	0,34
EUR	100.000	Aeroporti di Roma SpA 1.75% 30/07/2031	103.853	0,19	EUR	600.000	Cooperatieve Rabobank UA Perp FRN	667.504	1,20
EUR	100.000	Autostrade per l'Italia 2.00% 04/12/2028	105.248	0,19	GBP	260.000	E.ON International Finance BV 6.25% 03/06/2030	402.975	0,72
EUR	220.000	Banco BPM SpA 2.50% 21/06/2024	232.328	0,42	EUR	300.000	Iberdrola International BV Perp FRN	301.647	0,54
EUR	139.000	Eni SpA Perp FRN	141.181	0,25	EUR	200.000	ING Groep NV 0.38% 29/09/2028	198.050	0,36
		<b>Total de Italia</b>	<b>698.999</b>	<b>1,26</b>	USD	1.000.000	ING Groep NV Perp FRN	946.348	1,69
<b>JERSEY - ISLAS DEL CANAL</b>				<b>PAÍSES BAJOS</b>					
USD	505.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 1.75% 30/09/2027	440.905	0,79	EUR	287.000	Stedin Holding NV Perp FRN	292.423	0,52
USD	557.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.16% 31/03/2034	473.399	0,85	EUR	169.000	Tennet Holding BV Perp FRN	177.417	0,32
GBP	224.000	Hastings Group Finance plc 3.00% 24/05/2025	275.033	0,49	EUR	100.000	Volkswagen International Finance NV 4.13% 16/11/2038	138.331	0,25
							<b>Total de Países Bajos</b>	<b>3.316.338</b>	<b>5,94</b>

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade 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				
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>							
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>							
<b>NORUEGA</b>				<b>REINO UNIDO (continuación)</b>							
EUR	325.000	DNB Bank ASA FRN 23/02/2029	320.731	0,57	EUR	330.000	FCE Bank plc 1.13% 10/02/2022	331.282	0,59		
		<b>Total de Noruega</b>	<b>320.731</b>	<b>0,57</b>	GBP	130.000	GKN Holdings plc 5.38% 19/09/2022	157.150	0,28		
<b>ESPAÑA</b>				EUR				648.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	737.311	1,32
EUR	300.000	CaixaBank SA 1.13% 27/03/2026	313.237	0,56	EUR	152.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	172.950	0,31		
EUR	100.000	Nortegas Energia Distribucion SAU 2.07% 28/09/2027	108.050	0,19	GBP	500.000	HSBC Bank plc 5.38% 22/08/2033	758.027	1,36		
		<b>Total de España</b>	<b>421.287</b>	<b>0,75</b>	GBP	600.000	HSBC Holdings plc Perp FRN	767.637	1,38		
<b>SUECIA</b>				USD				380.000	Imperial Brands Finance plc 3.50% 26/07/2026	351.161	0,63
EUR	468.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	481.005	0,87	GBP	100.000	Imperial Brands Finance plc 5.50% 28/09/2026	135.891	0,24		
EUR	100.000	Sagax AB 2.00% 17/01/2024	104.107	0,19	GBP	126.000	Legal & General Group plc FRN 26/11/2049	156.009	0,29		
		<b>Total de Suecia</b>	<b>585.112</b>	<b>1,06</b>	GBP	100.000	Legal & General Group plc FRN 01/11/2050	130.824	0,23		
<b>SUIZA</b>				GBP				767.000	Lloyds Banking Group plc Perp FRN	938.452	1,67
EUR	257.000	Credit Suisse AG 0.25% 01/09/2028	251.246	0,45	GBP	550.000	Lloyds TSB Bank plc 7.63% 22/04/2025	780.941	1,40		
EUR	260.000	Credit Suisse Group AG 0.63% 18/01/2033	245.207	0,44	GBP	51.561	Marston's Issuer plc FRN 15/10/2027	55.960	0,10		
USD	400.000	Credit Suisse Group AG Perp FRN	377.736	0,67	EUR	400.000	Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	396.872	0,70		
EUR	308.000	UBS AG 0.50% 31/03/2031	305.364	0,55	EUR	226.000	Natwest Group plc FRN 26/02/2030	225.992	0,41		
USD	200.000	UBS Group AG Perp FRN	187.735	0,34	EUR	149.000	NatWest Group plc 1.04% 14/09/2032	148.579	0,27		
USD	200.000	UBS Group Funding Switzerland AG Perp FRN	188.291	0,34	GBP	130.000	NatWest Group plc FRN 28/11/2031	151.315	0,27		
		<b>Total de Suiza</b>	<b>1.555.579</b>	<b>2,79</b>	USD	280.000	NatWest Group plc FRN 08/05/2030	276.520	0,50		
<b>REINO UNIDO</b>				GBP				420.000	Natwest Group plc Perp FRN	525.410	0,94
GBP	149.000	Anglian Water Osprey Financing plc 2.00% 31/07/2028	172.711	0,31	EUR	313.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	319.229	0,57		
GBP	225.000	Barclays Bank plc 5.75% 14/09/2026	313.456	0,56	GBP	100.000	RI Finance FRN 30/11/2043	127.655	0,23		
EUR	100.000	Barclays plc FRN 12/05/2032	100.735	0,18	GBP	150.000	Santander UK plc Perp 10.06%	311.289	0,56		
GBP	300.000	Barclays plc Perp FRN	385.562	0,69	USD	940.000	SSE plc FRN 16/09/2077	829.135	1,49		
GBP	300.000	BAT International Finance plc 2.25% 26/06/2028	345.619	0,62	EUR	274.000	SSE plc Perp FRN	292.024	0,52		
USD	535.000	Bp Capital Markets plc Perp FRN	492.759	0,89	GBP	94.037	Telereal Securitisation plc 1.37% 10/12/2031	110.205	0,20		
GBP	45.167	Broadgate Financing plc 5.10% 05/04/2033	61.951	0,11	GBP	100.000	Telereal Securitisation plc FRN 10/12/2033	117.579	0,21		
GBP	224.000	BUPA Finance plc Perp 4.00%	257.075	0,46	GBP	138.631	Telereal Securitisation plc 5.43% 10/12/2031	193.419	0,35		
EUR	196.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	196.029	0,35	GBP	276.733	Tesco Property Finance 7.62% 13/07/2039	469.512	0,83		
EUR	233.000	Cadent Finance plc 0.75% 11/03/2032	231.071	0,41	GBP	89.741	Tesco Property Finance 3 plc 5.74% 13/04/2040	137.019	0,25		
GBP	235.000	Ds Smith plc 2.88% 26/07/2029	285.414	0,51							

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade 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
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>			
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Bonos (continuación)</b>			
<b>REINO UNIDO (continuación)</b>				<b>ESTADOS UNIDOS (continuación)</b>			
GBP	97.661 Tesco Property Finance 5 plc 5.66% 13/10/2041	148.966	0,27	USD	165.000 Verizon Communications Inc. 2.55% 21/03/2031	144.281	0,25
EUR	200.000 Thames Water Utilities Finance plc 0.19% 23/10/2023	200.805	0,36	<b>Total de Estados Unidos</b>			
GBP	128.000 Virgin Money UK plc FRN 19/08/2031	149.988	0,27	<b>Total de bonos</b>			
GBP	400.000 Western Power Distribution plc 3.50% 16/10/2026	509.053	0,92	<b>Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda</b>			
<b>Total del Reino Unido</b>		<b>13.956.543</b>	<b>25,01</b>	<b>ALEMANIA</b>			
<b>ESTADOS UNIDOS</b>				EUR	2.735.000 Germany (Govt of) 10/10/2025	2.806.183	5,03
USD	326.000 AbbVie Inc. 4.25% 21/11/2049	332.385	0,59	EUR	500.000 Germany (Govt of) 04/09/2022	510.310	0,91
USD	287.000 AT&T Inc. 2.55% 01/12/2033	243.993	0,44	GBP	600.000 Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.88% 15/09/2026	701.485	1,26
USD	125.000 AT&T Inc. 4.30% 15/12/2042	121.436	0,22	<b>Total de Alemania</b>			
USD	150.000 Bank of America Corp. FRN 21/07/2032	127.607	0,23	<b>Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda</b>			
USD	583.000 Bank of America Corp. FRN 22/04/2032	513.466	0,92	<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>			
EUR	289.000 Becton Dickinson and Company 0.00% 13/08/2023	289.878	0,52	<b>50.270.879 90,10</b>			
EUR	189.000 Digital Euro Finco LLC 1.13% 09/04/2028	194.639	0,35	<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente</b>			
EUR	118.000 Eli Lilly & Company 1.38% 14/09/2061	110.931	0,20	<b>Bonos</b>			
EUR	114.000 Fidelity National Information Services Inc. 2.95% 21/05/2039	138.499	0,25	<b>AUSTRALIA</b>			
USD	106.000 Goldman USA Finance Three LLC 3.70% 15/03/2028	99.161	0,18	USD	330.000 Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	319.663	0,57
USD	451.000 JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2032	394.615	0,71	<b>Total de Australia</b>			
EUR	175.000 Kraft Heinz Foods Company 2.25% 25/05/2028	190.604	0,34	<b>BERMUDAS</b>			
GBP	468.000 Kraft Heinz Foods Company 4.13% 01/07/2027	607.438	1,09	USD	320.000 Bacardi Limited 4.45% 15/05/2025	304.404	0,55
EUR	163.000 Netflix Inc. 3.00% 15/06/2025	177.344	0,32	USD	333.000 Bacardi Limited 4.70% 15/05/2028	332.897	0,60
EUR	220.000 Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	264.176	0,47	<b>Total de Bermudas</b>			
USD	144.000 Oracle Corp. 3.65% 25/03/2041	128.895	0,23	<b>637.301 1,15</b>			
EUR	70.000 Petroleos Mexicanos 5.50% 24/02/2025	76.602	0,14	<b>FRANCIA</b>			
USD	299.000 Plains All American Pipeline LP 3.55% 15/12/2029	271.438	0,49	USD	500.000 BPCE SA 2.70% 01/10/2029	447.880	0,80
EUR	130.000 Southern Company 1.88% 15/09/2081	129.446	0,23	<b>Total de Francia</b>			
EUR	134.000 Thermo Fisher Scientific Inc. 1.88% 01/10/2049	141.678	0,25	<b>447.880 0,80</b>			
GBP	295.000 Time Warner Cable Inc. 5.75% 02/06/2031	435.674	0,78				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade 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		
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)</b>				<b>Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>					
<b>Bonos (continuación)</b>				<b>Fondos</b>					
<b>PAÍSES BAJOS</b>				<b>IRLANDA</b>					
USD	50.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	46.596	0,08	209	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	20.579	0,04	
<b>Total de Países Bajos</b>			<b>46.596</b>	<b>0,08</b>	<b>Total de Irlanda</b>			<b>20.579</b>	<b>0,04</b>
<b>ESTADOS UNIDOS</b>				<b>Total de fondos</b>					
USD	391.000	Carrier Global Corp. 2.72% 15/02/2030	349.003	0,63	<b>Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>				
USD	271.000	Jersey Central Power & Light Company 2.75% 01/03/2032	239.684	0,43	<b>Valor total de las inversiones</b>				
<b>Total de Estados Unidos</b>			<b>588.687</b>	<b>1,06</b>	<b>(Coste total: 51.324.678 EUR)</b>				
<b>Total de bonos</b>			<b>2.040.127</b>	<b>3,66</b>	<b>52.515.935</b>				<b>94,13</b>
<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente</b>				<b>2.040.127</b>	<b>3,66</b>				
<b>Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario</b>									
<b>Bonos</b>									
<b>DINAMARCA</b>									
USD	215.000	Danske Bank AS 1.55% 10/09/2027	184.350	0,33					
<b>Total de Dinamarca</b>			<b>184.350</b>	<b>0,33</b>					
<b>Total de bonos</b>			<b>184.350</b>	<b>0,33</b>					
<b>Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario</b>			<b>184.350</b>	<b>0,33</b>					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha

### Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2021

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>			
<b>Renta variable</b>				<b>Renta variable (continuación)</b>			
<b>BÉLGICA</b>				<b>PAÍSES BAJOS (continuación)</b>			
95.768	KBC Group NV	7.473.734	5,06	589.397	ING Groep NV	7.407.542	5,01
	<b>Total de Bélgica</b>	<b>7.473.734</b>	<b>5,06</b>	40.542	Koninklijke DSM NV	7.003.630	4,74
				18.382	Wolters Kluwer NV	1.683.424	1,14
					<b>Total de Países Bajos</b>	<b>29.162.808</b>	<b>19,73</b>
<b>DINAMARCA</b>				<b>NORUEGA</b>			
7.216	DSV A/S	1.494.936	1,01	375.353	DNB Bank ASA	7.418.536	5,02
340.185	Tryg A/S	6.674.748	4,51		<b>Total de Noruega</b>	<b>7.418.536</b>	<b>5,02</b>
	<b>Total de Dinamarca</b>	<b>8.169.684</b>	<b>5,52</b>				
<b>FINLANDIA</b>				<b>ESPAÑA</b>			
21.253	Upm-Kymmene Oyj	652.680	0,44	166.369	Inditex SA	5.293.862	3,58
	<b>Total de Finlandia</b>	<b>652.680</b>	<b>0,44</b>		<b>Total de España</b>	<b>5.293.862</b>	<b>3,58</b>
<b>FRANCIA</b>				<b>SUECIA</b>			
29.968	Air Liquide SA	4.152.965	2,81	78.325	Epiroc AB	1.405.958	0,95
140.801	Edenred	6.565.551	4,44	58.317	Sandvik AB	1.157.241	0,78
2.282	Kering	1.405.712	0,95		<b>Total de Suecia</b>	<b>2.563.199</b>	<b>1,73</b>
2.323	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	1.440.492	0,97				
16.070	Pernod-Ricard SA	3.064.549	2,07				
26.174	Publicis Groupe SA	1.524.897	1,03				
10.766	Schneider Electric SE	1.549.227	1,05				
19.150	Teleperformance	6.512.915	4,41				
72.229	Worldline SA	4.767.836	3,22				
	<b>Total de Francia</b>	<b>30.984.144</b>	<b>20,95</b>				
<b>ALEMANIA</b>				<b>REINO UNIDO</b>			
5.308	Adidas AG	1.442.715	0,98	3.383.901	Barclays plc	7.464.384	5,05
85.362	Brenntag AG	6.878.470	4,65	558.353	JD Sports Fashion plc	6.811.069	4,60
34.622	Deutsche Boerse AG	4.864.391	3,29	15.875	Next plc	1.516.704	1,03
33.501	Puma AG Rudolf Dassler Sport	3.230.167	2,18		<b>Total del Reino Unido</b>	<b>15.792.157</b>	<b>10,68</b>
	<b>Total de Alemania</b>	<b>16.415.743</b>	<b>11,10</b>				
<b>ITALIA</b>				<b>Total de renta variable</b>			
27.519	Moncler SpA	1.459.057	0,99			<b>140.981.859</b>	<b>95,34</b>
122.069	Nexi SpA	1.972.635	1,33				
	<b>Total de Italia</b>	<b>3.431.692</b>	<b>2,32</b>				
<b>PAÍSES BAJOS</b>				<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>			
47.412	Akzo Nobel NV	4.474.745	3,03			<b>140.981.859</b>	<b>95,34</b>
2.311	ASML Holding NV	1.492.675	1,01				
42.970	IMCD Group NV	7.100.792	4,80				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.



## Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha

### Estado de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% de valor liquidativo
<b>Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>			
<b>Fondos</b>			
<b>IRLANDA</b>			
10.241	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	1.009.401	0,68
	<b>Total de Irlanda</b>	<b>1.009.401</b>	<b>0,68</b>
	<b>Total de fondos</b>	<b>1.009.401</b>	<b>0,68</b>
	<b>Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>	<b>1.009.401</b>	<b>0,68</b>
	<b>Valor total de las inversiones</b>	<b>141.991.260</b>	<b>96,02</b>
<b>(Coste total: 126.284.575 EUR)</b>			

## Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha

### Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2021

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>			
<b>Renta variable</b>				<b>Fondos</b>			
<b>SUIZA</b>				<b>IRLANDA</b>			
24.081	TE Connectivity Limited	3.304.395	2,88	1.020.852	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	1.020.852	0,89
<b>Total de Suiza</b>		<b>3.304.395</b>	<b>2,88</b>	<b>Total de Irlanda</b>		<b>1.020.852</b>	<b>0,89</b>
<b>ESTADOS UNIDOS</b>				<b>Total de fondos</b>			
12.292	Agco Corp.	1.506.139	1,31	<b>Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios</b>			
2.845	Alphabet Inc. - A	7.606.164	6,64	<b>1.020.852 0,89</b>			
1.674	Amazon.com Inc.	5.499.157	4,80	<b>Valor total de las inversiones</b>			
39.229	American Electric Power Company Inc.	3.184.610	2,78	<b>113.880.059 99,41</b>			
10.483	Aspen Technology Inc.	1.287.312	1,12	<b>(Coste total: 105.599.155 USD)</b>			
103.583	Bank of America Corp.	4.397.098	3,84				
74.893	Centene Corp.	4.666.583	4,07				
116.815	Cisco Systems Inc.	6.358.240	5,55				
62.560	CVS Health Corp.	5.308.842	4,63				
13.038	Doximity Inc.	1.052.167	0,92				
20.448	DuPont de Nemours Inc.	1.390.260	1,21				
4.006	Fair Isaac Corp.	1.594.108	1,39				
24.709	Hilton Worldwide Holdings Inc.	3.264.306	2,85				
55.101	Kontoor Brands Inc.	2.752.295	2,40				
4.787	Lam Research Corp.	2.724.521	2,38				
47.392	Livent Corp.	1.095.229	0,96				
18.394	Mastercard Inc. - A	6.395.226	5,58				
10.305	Mirati Therapeutics Inc.	1.823.058	1,59				
58.306	Morgan Stanley	5.673.756	4,95				
22.487	nCino Inc.	1.597.252	1,39				
10.025	Paypal Holdings Inc.	2.608.605	2,28				
56.740	Renewable Energy Group Inc.	2.848.348	2,49				
25.021	Salesforce.com Inc.	6.786.195	5,93				
37.057	Schnitzer Steel Industries Inc.	1.623.467	1,42				
24.012	State Street Corp.	2.034.297	1,78				
5.347	Svb Financial Group	3.458.867	3,02				
7.615	Teradata Corp.	436.720	0,38				
15.819	TransUnion	1.776.632	1,55				
19.414	Union Pacific Corp.	3.805.338	3,32				
27.266	United Parcel Service Inc.	4.965.139	4,34				
18.558	Vertex Pharmaceuticals Inc.	3.366.236	2,94				
20.265	VF Corp.	1.357.552	1,19				
24.417	Voya Financial Inc.	1.498.960	1,31				
19.636	Zoetis Inc.	3.812.133	3,33				
<b>Total de Estados Unidos</b>		<b>109.554.812</b>	<b>95,64</b>				
<b>Total de renta variable</b>		<b>112.859.207</b>	<b>98,52</b>				
<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>		<b>112.859.207</b>	<b>98,52</b>				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha

### Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2021

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>				<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)</b>			
<b>Renta variable</b>				<b>Renta variable (continuación)</b>			
<b>ISLAS CAIMÁN</b>				<b>JAPÓN</b>			
3.870	Sea Limited	1.233.485	1,15	3.900	Keyence Corp.	2.341.922	2,18
	<b>Total de Islas Caimán</b>	<b>1.233.485</b>	<b>1,15</b>	20.100	Rohm Company Limited	1.916.773	1,78
<b>DINAMARCA</b>				42.700	Sekisui Chemical Company Limited	737.467	0,68
15.464	Novo-Nordisk A/S	1.497.691	1,40	8.700	Sony Corp.	971.172	0,90
10.864	Orsted AS	1.437.223	1,34	25.200	Yaskawa Electric Corp.	1.219.628	1,13
40.640	Tryg A/S	924.141	0,86		<b>Total de Japón</b>	<b>7.186.962</b>	<b>6,67</b>
	<b>Total de Dinamarca</b>	<b>3.859.055</b>	<b>3,60</b>	<b>PAÍSES BAJOS</b>			
<b>FINLANDIA</b>				5.274	Airbus SE	703.526	0,65
24.583	Upm-Kymmene Oyj	874.942	0,81		<b>Total de Países Bajos</b>	<b>703.526</b>	<b>0,65</b>
	<b>Total de Finlandia</b>	<b>874.942</b>	<b>0,81</b>	<b>REPÚBLICA DE COREA (SUR)</b>			
<b>FRANCIA</b>				54.770	Samsung Electronics Company Limited	3.427.732	3,18
6.436	Essilor International SA	1.234.465	1,15	2.690	Samsung Sdi Company Limited	1.631.258	1,51
12.265	Schneider Electric SE	2.045.470	1,90		<b>Total de República de Corea (Sur)</b>	<b>5.058.990</b>	<b>4,69</b>
	<b>Total de Francia</b>	<b>3.279.935</b>	<b>3,05</b>	<b>SUIZA</b>			
<b>ALEMANIA</b>				3.863	Roche Holding AG	1.416.040	1,31
4.303	Adidas AG	1.355.456	1,26	12.645	TE Connectivity Limited	1.735.147	1,61
	<b>Total de Alemania</b>	<b>1.355.456</b>	<b>1,26</b>		<b>Total de Suiza</b>	<b>3.151.187</b>	<b>2,92</b>
<b>HONG KONG</b>				<b>TAIWÁN</b>			
79.400	AIA Group Limited	917.451	0,85	95.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	1.977.704	1,84
	<b>Total de Hong Kong</b>	<b>917.451</b>	<b>0,85</b>		<b>Total de Taiwán</b>	<b>1.977.704</b>	<b>1,84</b>
<b>INDIA</b>				<b>REINO UNIDO</b>			
76.123	HDFC Bank Limited	1.635.668	1,52	28.357	Diageo plc	1.378.760	1,28
	<b>Total de India</b>	<b>1.635.668</b>	<b>1,52</b>	42.853	SSE plc	907.737	0,84
					<b>Total del Reino Unido</b>	<b>2.286.497</b>	<b>2,12</b>
<b>INDONESIA</b>				<b>ESTADOS UNIDOS</b>			
5.373.049	Bank Rakyat Indonesia	1.445.347	1,34	9.937	Abbott Laboratories	1.173.858	1,09
	<b>Total de Indonesia</b>	<b>1.445.347</b>	<b>1,34</b>	7.528	Activision Blizzard Inc.	582.592	0,54
<b>IRLANDA</b>				1.401	Adobe Systems Inc.	806.584	0,75
10.617	CRH plc	499.073	0,46	3	Alphabet Inc. - A	8.021	0,01
23.746	Medtronic Inc.	2.976.562	2,77	2.227	Amazon.com Inc.	7.315.783	6,80
9.234	Trane Technologies plc	1.594.250	1,48	3.433	Autodesk Inc.	978.989	0,91
	<b>Total de Irlanda</b>	<b>5.069.885</b>	<b>4,71</b>	15.688	Centene Corp.	977.519	0,91
				29.783	Comcast Corp.	1.665.763	1,55

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha

### Estado de la Cartera

(continuación)

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

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

##### Renta variable (continuación)

##### ESTADOS UNIDOS (continuación)

3.400	Cooper Companies Inc.	1.405.254	1,30
6.321	Ecolab Inc.	1.318.687	1,22
7.921	Edwards Lifesciences Corp.	896.736	0,83
10.350	Electronic Arts Inc.	1.472.288	1,37
12.003	Fidelity National Information Services Inc.	1.460.525	1,36
27.379	General Motors Company	1.443.147	1,34
4.408	Intuit Inc.	2.378.159	2,20
4.359	JPMorgan Chase & Company	713.525	0,66
199	Lam Research Corp.	113.261	0,11
4.029	Mastercard Inc. - A	1.400.803	1,30
684	Mercadolibre Inc.	1.148.710	1,07
1.520	Micron Technology Inc.	107.890	0,10
14.402	NextEra Energy Inc.	1.130.845	1,05
10.820	Nvidia Corp.	2.241.471	2,08
9.813	Paypal Holdings Inc.	2.553.441	2,37
12.749	Pinterest Inc.	649.562	0,60
2.661	S&P Global Inc.	1.130.632	1,05
360	Stryker Corp.	94.939	0,09
2.057	Thermo Fisher Scientific Inc.	1.175.226	1,09
27.970	T-Mobile USA Inc.	3.573.447	3,32
1.151	TransUnion	129.269	0,12
39.206	Uber Technologies Inc.	1.756.429	1,63
8.021	Union Pacific Corp.	1.572.196	1,46
17.873	Walt Disney Company	3.023.576	2,80

**Total de Estados Unidos** **46.399.127** **43,08**

**Total de renta variable** **86.435.217** **80,26**

**Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa** **86.435.217** **80,26**

##### Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios

##### Fondos

##### IRLANDA

4.150.228	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	4.150.228	3,85
-----------	--	-----------	------

**Total de Irlanda** **4.150.228** **3,85**

**Total de fondos** **4.150.228** **3,85**

**Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios** **4.150.228** **3,85**

**Valor total de las inversiones** **90.585.445** **84,11**

(Coste total: 71.336.619 USD)

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

### Estado de la Cartera

a 30 de septiembre de 2021

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% de valor liquidativo
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>			
<b>Instrumentos estructurados - Materias primas</b>			
<b>IRLANDA</b>			
14.892	Invesco Physical Gold ETC 0.00%	2.537.522	0,63
	<b>Total de Irlanda</b>	<b>2.537.522</b>	<b>0,63</b>
<b>Total de instrumentos estructurados - Materias primas</b>		<b>2.537.522</b>	<b>0,63</b>
<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa</b>		<b>2.537.522</b>	<b>0,63</b>
<b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente</b>			
<b>Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda</b>			
<b>ESTADOS UNIDOS</b>			
USD 79.500.000	United States Treasury Bill 0.00% 07/10/2021	79.499.697	19,65
USD 79.500.000	United States Treasury Bill 0.00% 14/10/2021	79.499.563	19,65
USD 45.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 21/10/2021	44.998.290	11,12
USD 49.500.000	United States Treasury Bill 0.00% 28/10/2021	49.497.649	12,23
USD 69.500.000	United States Treasury Bill 0.00% 04/11/2021	69.496.338	17,18
USD 64.500.000	United States Treasury Bill 0.00% 09/11/2021	64.496.278	15,94
	<b>Total de Estados Unidos</b>	<b>387.487.815</b>	<b>95,77</b>
<b>Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda</b>		<b>387.487.815</b>	<b>95,77</b>
<b>Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente</b>		<b>387.487.815</b>	<b>95,77</b>
<b>Valor total de las inversiones</b>		<b>390.025.337</b>	<b>96,40</b>
<b>(Coste total: 390.113.321 USD)</b>			

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## Notas a los estados financieros

### 1 GENERAL

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

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

#### Acontecimientos significativos durante el periodo:

##### Nuevo folleto

Se ha publicado un nuevo Folleto en julio de 2021.

##### Reducción de comisiones

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

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

\* sin cambios

Consulte también la nota 5.

##### Cierre de cartera

Con efecto a partir del 21 de mayo de 2021, Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity Portfolio está en liquidación y sus Acciones ya no están disponibles para su suscripción.

##### Lanzamiento de Clases de Acciones

Las siguientes clases de acciones se lanzaron durante el periodo finalizado el 30 de septiembre de 2021:

Clase de Acciones	Cartera	Fecha Efectiva
IEP	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	8 de abril de 2021
ISC	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	29 de julio de 2021
AE	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	10 de junio de 2021
AEH	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	10 de junio de 2021
DE	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	10 de junio de 2021
DEH	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	10 de junio de 2021
ZE	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	15 de julio de 2021
AE	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	5 de agosto de 2021
IE	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	5 de agosto de 2021

**A 30 de septiembre de 2021, 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 Bonds<sup>1</sup>
- Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt
- Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds<sup>1</sup>
- Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond<sup>1</sup>
- Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 1 GENERAL

(continuación)

#### Las Carteras de asignación de activos:

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

#### Las Carteras de renta variable:

- Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities
- Threadneedle (Lux) - Global Focus<sup>1</sup>
- Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities<sup>1</sup>
- Threadneedle (Lux) - Global Equity Income
- Threadneedle (Lux) - Global Select
- Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) - American<sup>1</sup>
- Threadneedle (Lux) - American Select
- Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity<sup>1</sup>
- 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 Opportunities<sup>1</sup>
- Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) - European Select
- Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income<sup>1</sup>
- Threadneedle (Lux) - Global Technology<sup>1</sup>
- Threadneedle (Lux) - UK Equities
- Threadneedle (Lux) - UK Equity Income

#### Las Carteras de rendimiento absoluto:

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

#### Las Carteras de Extended Alpha:

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

#### La Cartera de especialistas:

- Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

<sup>1</sup> A 30 de septiembre de 2021, 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 2021. El último Valor liquidativo oficial de las Carteras correspondientes se ha calculado a partir del 30 de septiembre de 2021.

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

## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 2 RESUMEN DE POLÍTICAS CONTABLES SIGNIFICATIVAS

(continuación)

#### I) Valoración de valores

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

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

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

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

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

#### II) Contratos de divisas a plazo

Con el fin de cubrir el riesgo de divisa específico o la inversión en otras divisas, la SICAV podrá celebrar contratos de divisas a plazo. 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 2021 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 2021 figuran en la Nota 11.

#### IV) Swaps

La SICAV podrá participar en swaps de tipos de interés («IRS», por sus siglas en inglés), swaps de incumplimiento crediticio («CDS», por sus siglas en inglés) y Swaps de rentabilidad total («SRT»). Los IRS se valoran sobre la base de su valor de mercado establecido por referencia a la curva del tipo de interés aplicable. Los CDS se valoran por referencia al valor presente neto de los flujos de efectivo futuros esperados según los tipos de interés del mercado y la tasa de incumplimiento y recuperación esperada del mercado del activo subyacente. Un pago por adelantado, si lo hubiera, realizado por la SICAV se registra como 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 2021 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 2021 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 2021 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»).



## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 2 RESUMEN DE POLÍTICAS CONTABLES SIGNIFICATIVAS

(continuación)

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 2021 son: 1 USD = 1,384370 AUD, 1 USD = 0,862850 EUR, 1 USD = 0,741647 GBP, 1 USD = 0,932850 CHF, 1 USD = 8,748524 SEK, 1 USD = 6,416097 DKK, 1 USD = 8,729279 NOK, 1 USD = 7,784646 HKD y 1 USD = 1,357600 SGD.

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

#### VII) Efectivo en el banco

El efectivo en el banco reflejado en los estados del patrimonio neto incluye también los márgenes sobre los contratos de futuros y las garantías en efectivo debidas por los corredores de bolsa 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 SICAV.

#### 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.

## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 3 TRIBUTACIÓN

(continuación)

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

A 30 de septiembre de 2021, no hay comisiones varias.

### 5 OPERACIONES VINCULADAS

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

Para el periodo que finaliza el 30 de septiembre de 2021, la SICAV no realizó operaciones con personas relacionadas.

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

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

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

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, los «Gastos operativos»), la «Comisión de gestión de activos» o los «Cargos de Cartera», juntos, los «Gastos») se fijan a las tasas mostradas en las tablas de la página 235 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 235 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.

## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 5 OPERACIONES VINCULADAS

(continuación)

#### ACCIONES A:

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

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

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

## 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
<b>Carteras de renta variable</b>				
<i>(continuación)</i>				
	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
<b>Carteras de rendimiento absoluto</b>				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	1,50%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	1,00%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,90%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	1,50%	0,35%	EUR
<b>Carteras de Extended Alpha</b>				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	1,50%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	1,50%	0,30%	USD
<b>Cartera de especialistas</b>				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	1,75%	0,30%	USD

#### ACCIONES B:

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

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

#### ACCIONES D:

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

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

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
<b>Carteras de bonos</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	1,35%	0,25%	USD
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	1,45%	0,25%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	1,45%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,45%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	1,45%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	1,45%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	1,20%	0,25%	USD
<b>Carteras de asignación de activos</b>				
	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

## 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
<b>Carteras de renta variable</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	2,25%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	2,25%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	2,00%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	2,00%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - American	1,85%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	2,25%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	2,00%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	2,25%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	2,00%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	2,00%	0,35%	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,75%	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	1,50%	0,25%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	1,85%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	2,40%	0,35%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	2,00%	0,35%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	2,25%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	2,00%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	2,25%	0,35%	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	2,25%	0,30%	GBP
<b>Carteras de rendimiento absoluto</b>				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	2,00%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	1,45%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	2,00%	0,35%	EUR
<b>Carteras de Extended Alpha</b>				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	2,00%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	2,00%	0,30%	USD
<b>Cartera de especialistas</b>				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	2,25%	0,30%	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
<b>Carteras de bonos</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,50%	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,40%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,65%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	0,40%	0,10%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	0,30%	0,10%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	0,40%	0,15%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	0,65%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	0,65%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	0,65%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	0,55%	0,10%	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	0,40%	0,15%	USD

## 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
<b>Carteras de asignación de activos</b>				
	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	0,65%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	0,75%	0,20%	USD
<b>Carteras de renta variable</b>				
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	0,65%	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	0,75%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	0,75%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,75%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	0,75%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	0,75%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - American	0,70%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	0,80%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	0,75%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	0,75%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	0,75%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	0,80%	0,25%	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,25%	0,10%	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	0,65%	0,15%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	0,50% <sup>1</sup>	0,15% <sup>2</sup>	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	0,85%	0,25%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	0,75%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	0,75%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	0,75%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	0,75%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	0,85%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,65%	0,20%	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,65%	0,20%	GBP
	Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity*	1,25%	0,35%	USD
<b>Carteras de rendimiento absoluto</b>				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	0,75%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	0,50%	0,10%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,35%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	0,75%	0,20%	EUR
<b>Carteras de Extended Alpha</b>				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75%	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	0,75%	0,15%	USD
<b>Cartera de especialistas</b>				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	0,80%	0,20%	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
<b>Cartera de rendimiento absoluto</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,25%	0,20%	EUR

## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 5 OPERACIONES VINCULADAS

(continuación)

#### ACCIONES L:

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

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

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

#### ACCIONES N:

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

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

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
<b>Carteras de bonos</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,30%	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	0,30%	0,10%	EUR
<b>Carteras de renta variable</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	0,55%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,10%	0,10%	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,60%	0,08%	GBP
<b>Cartera de especialistas</b>				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	0,45%	0,20%	USD

#### ACCIONES S:

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

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

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

## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 5 OPERACIONES VINCULADAS

(continuación)

#### ACCIONES T:

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

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

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

#### ACCIONES W:

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

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

<b>Tipo de Cartera</b>	<b>Nombre de la Cartera</b>	<b>Comisión de gestión de activos</b>	<b>Gastos operativos</b>	<b>Divisa base</b>
<b>Carteras de bonos</b>				
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	1,00%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,00%	0,30%	USD
<b>Cartera de asignación de activos</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	1,40%	0,35%	USD
<b>Carteras de renta variable</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	1,40%	0,35%	USD
	Threadneedle (Lux) - American	1,15%	0,35%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,40%	0,35%	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	1,40%	0,35%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	1,55%	0,35%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	1,65%	0,35%	USD

#### ACCIONES X:

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



## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 5 OPERACIONES VINCULADAS

(continuación)

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

#### ACCIONES Y:

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

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

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

## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 5 OPERACIONES VINCULADAS

(continuación)

#### ACCIONES Z:

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

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

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
<b>Carteras de bonos</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,40%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,40%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,60%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	0,40%	0,15%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	0,30%	0,15%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	0,60%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	0,60%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	0,60%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	0,40%	0,25%	USD
<b>Carteras de asignación de activos</b>				
	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	0,75%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	0,75%	0,30%	USD
<b>Carteras de renta variable</b>				
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	0,75%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	0,75%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	0,75%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,75%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	0,75%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	0,75%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - American	0,75%	0,25%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	0,75%	0,35%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	0,75%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	0,75%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	0,75%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	0,75%	0,35%	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,30%	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	0,75%	0,25%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	0,75%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	0,75%	0,35%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	0,75%	0,35%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	0,75%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	0,75%	0,35%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	0,75%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	0,85%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,75%	0,30%	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,75%	0,30%	GBP
	Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity*	1,25%	0,35%	USD

## 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
<b>Carteras de rendimiento absoluto</b>				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	0,75%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	0,55%	0,15% <sup>3</sup>	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,45%	0,25%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	0,75%	0,30%	EUR
<b>Carteras de Extended Alpha</b>				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	0,75%	0,30%	USD
<b>Cartera de especialistas</b>				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	0,75%	0,30%	USD

#### ACCIONES 1:

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

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

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
<b>Carteras de bonos</b>				
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	1,00%	0,19%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	1,20%	0,18%	EUR
<b>Carteras de renta variable</b>				
	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
<b>Cartera de rendimiento absoluto</b>				
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	1,00%	0,17%	EUR
<b>Carteras de Extended Alpha</b>				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	1,50%	0,19%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	1,50%	0,19%	USD

## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 5 OPERACIONES VINCULADAS

(continuación)

#### ACCIONES 2:

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

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

#### ACCIONES 3:

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

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

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
<b>Carteras de bonos</b>				
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,50%	0,19%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,60%	0,17%	EUR
<b>Carteras de renta variable</b>				
	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
<b>Carteras de renta variable</b>				
<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
<b>Cartera de Extended Alpha</b>				
	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
<b>Carteras de bonos</b>			
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,08%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,07%	EUR
<b>Carteras de renta variable</b>			
	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
<b>Cartera de rendimiento absoluto</b>			
	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
<b>Carteras de bonos</b>				
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,50%	0,12%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,75%	0,11%	EUR
<b>Carteras de renta variable</b>				
	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

## 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
<b>Carteras de renta variable</b>				
<i>(continuación)</i>				
	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
<b>Cartera de rendimiento absoluto</b>				
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	0,50%	0,10%	EUR
<b>Carteras de Extended Alpha</b>				
	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
<b>Carteras de bonos</b>				
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,50%	0,15%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,60%	0,13%	EUR
<b>Carteras de renta variable</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,75%	0,14%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	0,75%	0,11%	USD
	Threadneedle (Lux) - American	0,75%	0,09%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	0,75%	0,08%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	0,75%	0,14%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	0,75%	0,16%	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	0,75%	0,15%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	0,75%	0,16%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	0,75%	0,12%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	0,75%	0,09%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	0,75%	0,14%	EUR
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,75%	0,08%	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,75%	0,09%	GBP
<b>Cartera de Extended Alpha</b>				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75%	0,15%	USD

\* Consulte la nota 1.

<sup>1</sup> El 0,75% hasta el 31 de agosto de 2021.<sup>2</sup> El 0,20% hasta el 31 de agosto de 2021.<sup>3</sup> El 0,25% hasta el 31 de agosto de 2021.

## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 6 ACUERDOS DE REPARTO DE COMISIONES

La Sociedad Gestora y algunos Subasesores podrán celebrar acuerdos de reparto de comisiones con corredores-agentes en virtud de los cuales determinados servicios comerciales se obtienen directamente de dichos corredores-agentes o de terceros y son pagados por los corredores-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-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-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) las comisiones de corretaje sobre las operaciones de cartera de la SICAV serán asignadas por la Sociedad Gestora o el Subasesor a los corredores-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-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 sus personas vinculadas podrán retener reembolsos en efectivo o de otro tipo por parte de los corredores-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 y servicios recibidos. Los bienes y servicios recibidos pueden incluir: investigación que pueda agregar valor al proceso de toma de decisiones de un Subasesor y servicios de ejecución que mejoren la capacidad del Subasesor para ejecutar transacciones.

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

### 7 DIVIDENDOS

La SICAV declaró los siguientes dividendos durante el periodo finalizado el 30 de septiembre de 2021:

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa de la clase de acciones	Importe por Acción	Importe total
				(en la divisa de la clase de acciones)	(en la divisa de la cartera)
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	Clase AEC	24/06/2021	EUR	0,065	119.718
	Clase AEC	24/09/2021	EUR	0,066	119.934
	Clase AUP	24/06/2021	USD	0,070	6.531
	Clase AUP	24/09/2021	USD	0,073	8.164
	Clase DEC	24/06/2021	EUR	0,060	7.214
	Clase DEC	24/09/2021	EUR	0,059	7.004
	Clase DUP	24/06/2021	USD	0,068	3.960
	Clase DUP	24/09/2021	USD	0,067	3.659
	Clase IEC	24/06/2021	EUR	0,063	153.279
	Clase IEC	24/09/2021	EUR	0,062	156.909
	Clase IEP	24/06/2021	EUR	0,065	8
	Clase IEP	24/09/2021	EUR	0,065	6
	Clase IGC	24/06/2021	GBP	0,062	18.371
	Clase IGC	24/09/2021	GBP	0,065	16.923
	Clase IUP	24/06/2021	USD	0,067	14.801
	Clase IUP	24/09/2021	USD	0,068	36.735
	Clase NEC	24/06/2021	EUR	0,064	14.293
	Clase NEC	24/09/2021	EUR	0,064	14.117
	Clase NGC	24/06/2021	GBP	0,061	868.875
	Clase NGC	24/09/2021	GBP	0,064	969.086
Clase NUP	24/06/2021	USD	0,067	5.904	
Clase NUP	24/09/2021	USD	0,067	5.688	
					<b>2.551.179 USD</b>

## 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)
<b>Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond</b>	Clase IEP	24/06/2021	EUR	0,028	3
	Clase IEP	24/09/2021	EUR	0,037	3
					<b>6 EUR</b>
<b>Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond</b>	Clase 1UT	26/04/2021	USD	0,031	5.579
	Clase 1UT	21/05/2021	USD	0,025	5.803
	Clase 1UT	24/06/2021	USD	0,034	8.101
	Clase 1UT	26/07/2021	USD	0,032	7.832
	Clase 1UT	24/08/2021	USD	0,032	7.849
	Clase 1UT	24/09/2021	USD	0,031	7.598
					<b>42.762 EUR</b>
<b>Threadneedle (Lux) - European Social Bond</b>	Clase AEP	24/06/2021	EUR	0,026	78
	Clase AEP	24/09/2021	EUR	0,026	1.170
	Clase ASC	24/06/2021	SGD	0,026	2
	Clase ASC	24/09/2021	SGD	0,026	2
	Clase AUC	24/06/2021	USD	0,028	2
	Clase AUC	24/09/2021	USD	0,029	2
	Clase IEP	24/06/2021	EUR	0,026	81.999
	Clase IEP	24/09/2021	EUR	0,026	85.835
	Clase ISC	24/06/2021	SGD	0,026	2
	Clase ISC	24/09/2021	SGD	0,026	2
	Clase IUC	24/06/2021	USD	0,028	2
	Clase IUC	24/09/2021	USD	0,026	606
	Clase NEP	24/06/2021	EUR	2,700	249.906
	Clase NEP	24/09/2021	EUR	2,621	254.973
	Clase ZEP	24/06/2021	EUR	0,027	8.546
	Clase ZEP	24/09/2021	EUR	0,026	12.884
Clase ZGC	24/06/2021	GBP	0,027	54.969	
Clase ZGC	24/09/2021	GBP	0,027	68.716	
					<b>819.696 EUR</b>
<b>Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond</b>	Clase AEP	26/04/2021	EUR	0,032	23.679
	Clase AEP	21/05/2021	EUR	0,032	23.157
	Clase AEP	24/06/2021	EUR	0,032	23.231
	Clase AEP	26/07/2021	EUR	0,032	23.267
	Clase AEP	24/08/2021	EUR	0,032	23.784
	Clase AEP	24/09/2021	EUR	0,035	25.411
	Clase DEP	26/04/2021	EUR	0,024	39.117
	Clase DEP	21/05/2021	EUR	0,024	40.122
	Clase DEP	24/06/2021	EUR	0,024	41.969
	Clase DEP	26/07/2021	EUR	0,024	42.803
	Clase DEP	24/08/2021	EUR	0,024	43.383
Clase DEP	24/09/2021	EUR	0,026	47.210	
					<b>397.133 EUR</b>



## 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)
<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds</b>	Clase AEC	26/04/2021	EUR	0,043	26.733
	Clase AEC	21/05/2021	EUR	0,043	26.971
	Clase AEC	24/06/2021	EUR	0,043	26.363
	Clase AEC	26/07/2021	EUR	0,043	25.371
	Clase AEC	24/08/2021	EUR	0,043	24.921
	Clase AEC	24/09/2021	EUR	0,043	24.821
	Clase AUP	26/04/2021	USD	0,028	22.712
	Clase AUP	21/05/2021	USD	0,028	21.719
	Clase AUP	24/06/2021	USD	0,028	21.565
	Clase AUP	26/07/2021	USD	0,028	21.399
	Clase AUP	24/08/2021	USD	0,028	21.579
	Clase AUP	24/09/2021	USD	0,028	21.542
	Clase DEC	26/04/2021	EUR	0,032	2.117
	Clase DEC	21/05/2021	EUR	0,032	2.130
	Clase DEC	24/06/2021	EUR	0,031	1.965
	Clase DEC	26/07/2021	EUR	0,031	1.942
	Clase DEC	24/08/2021	EUR	0,031	1.942
	Clase DEC	24/09/2021	EUR	0,031	1.845
	Clase IEC	26/04/2021	EUR	0,033	4
	Clase IEC	21/05/2021	EUR	0,033	12.299
	Clase IEC	24/06/2021	EUR	0,033	11.980
	Clase IEC	26/07/2021	EUR	0,033	11.842
	Clase IEC	24/08/2021	EUR	0,033	11.820
	Clase IEC	24/09/2021	EUR	0,033	11.829
	Clase XUP	24/06/2021	USD	0,112	11
	Clase XUP	24/09/2021	USD	0,129	11
					<b>357.433 USD</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt</b>	Clase AEC	26/04/2021	EUR	0,035	3.126
	Clase AEC	21/05/2021	EUR	0,035	3.170
	Clase AEC	24/06/2021	EUR	0,036	3.140
	Clase AEC	26/07/2021	EUR	0,036	3.042
	Clase AEC	24/08/2021	EUR	0,036	2.974
	Clase AEC	24/09/2021	EUR	0,037	3.057
	Clase AUP	26/04/2021	USD	0,043	134.552
	Clase AUP	21/05/2021	USD	0,043	133.785
	Clase AUP	24/06/2021	USD	0,044	136.088
	Clase AUP	26/07/2021	USD	0,044	134.286
	Clase AUP	24/08/2021	USD	0,044	132.261
	Clase AUP	24/09/2021	USD	0,046	136.512
	Clase SUP	26/04/2021	USD	0,041	2.108
	Clase SUP	21/05/2021	USD	0,041	2.108
	Clase SUP	24/06/2021	USD	0,042	2.160
	Clase SUP	26/07/2021	USD	0,042	2.155
	Clase SUP	24/08/2021	USD	0,042	2.128
	Clase SUP	24/09/2021	USD	0,044	2.226

## 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)
<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt</b> (continuación)					
	Clase XUP	24/06/2021	USD	0,122	12
	Clase XUP	24/09/2021	USD	0,134	12
					<b>838.902 USD</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds</b>					
	Clase AEC	26/04/2021	EUR	0,021	89.183
	Clase AEC	21/05/2021	EUR	0,021	66.070
	Clase AEC	24/06/2021	EUR	0,021	64.297
	Clase AEC	26/07/2021	EUR	0,021	63.572
	Clase AEC	24/08/2021	EUR	0,021	63.480
	Clase AEC	24/09/2021	EUR	0,021	63.189
	Clase ASC	26/04/2021	SGD	0,029	3.075
	Clase ASC	21/05/2021	SGD	0,029	3.044
	Clase ASC	24/06/2021	SGD	0,029	2.966
	Clase ASC	26/07/2021	SGD	0,029	2.939
	Clase ASC	24/08/2021	SGD	0,029	2.994
	Clase ASC	24/09/2021	SGD	0,028	2.916
	Clase AUP	26/04/2021	USD	0,023	38.087
	Clase AUP	21/05/2021	USD	0,023	37.686
	Clase AUP	24/06/2021	USD	0,022	35.938
	Clase AUP	26/07/2021	USD	0,022	35.557
	Clase AUP	24/08/2021	USD	0,022	35.300
	Clase AUP	24/09/2021	USD	0,022	34.683
	Clase XUP	26/04/2021	USD	0,039	35.263
	Clase XUP	21/05/2021	USD	0,039	35.263
	Clase XUP	24/06/2021	USD	0,039	35.263
	Clase XUP	26/07/2021	USD	0,039	35.263
	Clase XUP	24/08/2021	USD	0,039	35.263
	Clase XUP	24/09/2021	USD	0,039	34.036
					<b>855.327 USD</b>
<b>Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond</b>					
	Clase AEC	26/04/2021	EUR	0,055	1.948
	Clase AEC	21/05/2021	EUR	0,055	1.975
	Clase AEC	24/06/2021	EUR	0,055	1.924
	Clase AEC	26/07/2021	EUR	0,055	1.902
	Clase AEC	24/08/2021	EUR	0,055	1.903
	Clase AEC	24/09/2021	EUR	0,055	1.904
	Clase AUP	26/04/2021	USD	0,059	17.179
	Clase AUP	21/05/2021	USD	0,059	17.188
	Clase AUP	24/06/2021	USD	0,059	17.159
	Clase AUP	26/07/2021	USD	0,059	17.476
	Clase AUP	24/08/2021	USD	0,059	15.495
	Clase AUP	24/09/2021	USD	0,059	15.517
	Clase DEC	26/04/2021	EUR	0,041	1.483
	Clase DEC	21/05/2021	EUR	0,041	1.464

## 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)
<b>Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond</b> (continuación)					
	Clase DEC	24/06/2021	EUR	0,042	1.461
	Clase DEC	26/07/2021	EUR	0,042	1.444
	Clase DEC	24/08/2021	EUR	0,042	1.446
	Clase DEC	24/09/2021	EUR	0,042	1.473
	Clase IEC	26/04/2021	EUR	0,040	5
	Clase IEC	21/05/2021	EUR	0,040	5
	Clase IEC	24/06/2021	EUR	0,040	5
	Clase IEC	26/07/2021	EUR	0,040	5
	Clase IEC	24/08/2021	EUR	0,040	4
	Clase IEC	24/09/2021	EUR	0,041	4
	Clase ISC	24/08/2021	SGD	0,044	4
	Clase ISC	24/09/2021	SGD	0,044	4
	Clase XUP	24/06/2021	USD	0,139	14
	Clase XUP	24/09/2021	USD	0,149	13
					<b>120.404 USD</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond</b>					
	Clase ASC	26/04/2021	SGD	0,032	323
	Clase ASC	21/05/2021	SGD	0,032	339
	Clase ASC	24/06/2021	SGD	0,032	335
	Clase ASC	26/07/2021	SGD	0,032	342
	Clase ASC	24/08/2021	SGD	0,032	263
	Clase ASC	24/09/2021	SGD	0,034	79
	Clase AUP	26/04/2021	USD	0,033	40.709
	Clase AUP	21/05/2021	USD	0,033	39.558
	Clase AUP	24/06/2021	USD	0,033	39.672
	Clase AUP	26/07/2021	USD	0,033	35.614
	Clase AUP	24/08/2021	USD	0,033	32.918
	Clase AUP	24/09/2021	USD	0,036	31.886
	Clase AVC	26/04/2021	AUD	0,031	2
	Clase AVC	21/05/2021	AUD	0,031	2
	Clase AVC	24/06/2021	AUD	0,031	2
	Clase AVC	26/07/2021	AUD	0,031	2
	Clase AVC	24/08/2021	AUD	0,031	2
	Clase AVC	24/09/2021	AUD	0,033	2
	Clase ZUP	26/04/2021	USD	0,032	3
	Clase ZUP	21/05/2021	USD	0,032	3
	Clase ZUP	24/06/2021	USD	0,032	3
	Clase ZUP	26/07/2021	USD	0,032	3
	Clase ZUP	24/08/2021	USD	0,032	3
	Clase ZUP	24/09/2021	USD	0,034	3
					<b>222.068 USD</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return</b>					
	Clase AEP	24/09/2021	EUR	0,002	0*
	Clase IEP	24/09/2021	EUR	0,002	0*
	Clase LEP	24/09/2021	EUR	0,002	0*
	Clase ZEP	24/09/2021	EUR	0,002	1
					<b>1 EUR</b>

## 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)
<b>Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return</b>	Clase AEC	26/04/2021	EUR	0,012	923
	Clase AEC	21/05/2021	EUR	0,012	933
	Clase AEC	24/06/2021	EUR	0,018	1.363
	Clase AEC	26/07/2021	EUR	0,018	1.348
	Clase AEC	24/08/2021	EUR	0,018	1.347
	Clase AEC	24/09/2021	EUR	0,015	1.123
	Clase AUP	26/04/2021	USD	0,014	5.272
	Clase AUP	21/05/2021	USD	0,014	5.213
	Clase AUP	24/06/2021	USD	0,021	7.764
	Clase AUP	26/07/2021	USD	0,021	7.629
	Clase AUP	24/08/2021	USD	0,021	7.605
	Clase AUP	24/09/2021	USD	0,018	6.417
					<b>46.937 USD</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income</b>	Clase AEC	24/06/2021	EUR	0,104	663.930
	Clase AEC	24/09/2021	EUR	0,104	636.548
	Clase AEP	24/06/2021	EUR	0,117	237.007
	Clase AEP	24/09/2021	EUR	0,118	230.570
	Clase ASC	24/06/2021	SGD	0,122	1.593
	Clase ASC	24/09/2021	SGD	0,121	2.512
	Clase ASP	24/06/2021	SGD	0,121	523
	Clase ASP	24/09/2021	SGD	0,121	540
	Clase AUM	26/04/2021	USD	0,042	1.712
	Clase AUM	21/05/2021	USD	0,042	1.712
	Clase AUM	24/06/2021	USD	0,043	1.752
	Clase AUM	26/07/2021	USD	0,043	1.752
	Clase AUM	24/08/2021	USD	0,043	1.752
	Clase AUM	24/09/2021	USD	0,043	1.752
	Clase AUP	24/06/2021	USD	0,123	138.327
	Clase AUP	24/09/2021	USD	0,122	133.724
	Clase DEC	24/06/2021	EUR	0,099	355.070
	Clase DEC	24/09/2021	EUR	0,098	337.554
	Clase DEP	24/06/2021	EUR	0,111	47.720
	Clase DEP	24/09/2021	EUR	0,111	45.133
Clase DUP	24/06/2021	USD	0,112	235.562	
Clase DUP	24/09/2021	USD	0,111	230.314	
Clase ZEC	24/06/2021	EUR	0,115	14	
Clase ZEC	24/09/2021	EUR	0,114	12	
Clase ZUP	24/06/2021	USD	0,123	12	
Clase ZUP	24/09/2021	USD	0,123	12	
					<b>3.307.109 USD</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities</b>	Clase AEC	24/09/2021	EUR	0,064	8
	Clase AUP	24/09/2021	USD	0,064	6
	Clase ZEC	24/09/2021	EUR	0,064	8
	Clase ZUP	24/09/2021	USD	0,064	6
					<b>28 USD</b>

## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa de la clase de acciones	Importe por Acción	Importe total
				(en la divisa de la clase de acciones)	(en la divisa de la cartera)
<b>Threadneedle (Lux) - Global Focus</b>	Clase AEP	24/09/2021	EUR	0,083	216.877
	Clase AUP	24/09/2021	USD	0,067	2.258
	Clase IUP	24/09/2021	USD	0,069	3.451
	Clase ZEP	24/09/2021	EUR	0,080	246.548
					<b>469.134 USD</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Global Equity Income</b>	Clase AEC	24/06/2021	EUR	0,110	635
	Clase AEC	24/09/2021	EUR	0,064	363
	Clase AUP	24/06/2021	USD	0,117	12
	Clase AUP	24/09/2021	USD	0,070	6
	Clase DEC	24/06/2021	EUR	0,110	13
	Clase DEC	24/09/2021	EUR	0,063	6
	Clase DUP	24/06/2021	USD	0,115	12
	Clase DUP	24/09/2021	USD	0,069	6
	Clase 1EP	24/06/2021	EUR	0,115	210.331
	Clase 1EP	24/09/2021	EUR	0,067	120.189
	Clase 1SC	24/06/2021	SGD	0,119	40.317
	Clase 1SC	24/09/2021	SGD	0,068	22.717
	Clase 1ST	26/04/2021	SGD	0,040	2.503
	Clase 1ST	21/05/2021	SGD	0,044	2.788
	Clase 1ST	24/06/2021	SGD	0,030	1.892
	Clase 1ST	26/07/2021	SGD	0,013	665
	Clase 1ST	24/08/2021	SGD	0,036	1.821
	Clase 1ST	24/09/2021	SGD	0,026	1.059
	Clase 1UP	24/06/2021	USD	0,118	51.262
	Clase 1UP	24/09/2021	USD	0,069	29.575
	Clase 1VT	26/04/2021	AUD	0,039	223
	Clase 1VT	21/05/2021	AUD	0,043	247
	Clase 1VT	24/06/2021	AUD	0,030	167
	Clase 1VT	26/07/2021	AUD	0,010	54
	Clase 1VT	24/08/2021	AUD	0,035	189
	Clase 1VT	24/09/2021	AUD	0,021	115
	Clase 2EP	24/06/2021	EUR	0,115	14
	Clase 2EP	24/09/2021	EUR	0,068	6
	Clase 2UP	24/06/2021	USD	0,119	12
	Clase 2UP	24/09/2021	USD	0,072	6
	Clase 3EP	24/06/2021	EUR	0,114	1.349.752
	Clase 3EP	24/09/2021	EUR	0,069	806.124
Clase 3UP	24/06/2021	USD	0,119	4.680	
Clase 3UP	24/09/2021	USD	0,070	2.759	
Clase 8EP	24/06/2021	EUR	0,114	23	
Clase 8EP	24/09/2021	EUR	0,068	19	
Clase 8UP	24/06/2021	USD	0,119	6.890	
Clase 8UP	24/09/2021	USD	0,070	4.059	
Clase 9EP	24/06/2021	EUR	0,115	14	
Clase 9EP	24/09/2021	EUR	0,068	6	

## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa de la clase de acciones	Importe por Acción (en la divisa de la clase de acciones)	Importe total (en la divisa de la cartera)
<b>Threadneedle (Lux) - Global Equity Income</b> <i>(continuación)</i>					
	Clase 9UP	24/06/2021	USD	0,119	12
	Clase 9UP	24/09/2021	USD	0,072	6
					<b>2.661.549 USD</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity</b>					
	Clase XUP	24/09/2021	USD	0,230	885.956
					<b>885.956 USD</b>
<b>Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities</b>					
	Clase AEC	24/09/2021	EUR	0,116	46
	Clase AUP	24/09/2021	USD	0,125	1.354
					<b>1.400 USD</b>
<b>Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities</b>					
	Clase AUP	24/09/2021	USD	0,138	47
	Clase IEC	24/09/2021	EUR	0,129	9
					<b>56 USD</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend</b>					
	Clase AEP	24/09/2021	EUR	0,292	3.134
	Clase AUP	24/09/2021	USD	0,312	21
	Clase DEP	24/09/2021	EUR	0,289	755
	Clase IEP	24/09/2021	EUR	0,299	188.003
	Clase ZEP	24/09/2021	EUR	0,298	4.670
	Clase 1EP	24/09/2021	EUR	0,030	321.819
	Clase 1GP	24/09/2021	GBP	0,025	9.937
	Clase 2EP	24/09/2021	EUR	0,298	21
	Clase 2GP	24/09/2021	GBP	0,290	21
	Clase 3EP	24/09/2021	EUR	0,047	3.349
	Clase 3GP	24/09/2021	GBP	0,040	35.200
	Clase 4GP	24/09/2021	GBP	0,037	279.782
	Clase 8EP	24/09/2021	EUR	0,031	29.686
	Clase 8GP	24/09/2021	GBP	0,027	13.993
	Clase 9EP	24/09/2021	EUR	0,319	2.670
	Clase 9GP	24/09/2021	GBP	0,290	21
					<b>893.082 EUR</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income</b>					
	Clase AUP	24/09/2021	USD	0,323	6.766
	Clase DUP	24/09/2021	USD	0,317	6.709
	Clase IEP	24/09/2021	EUR	0,316	197.969
	Clase XUP	24/09/2021	USD	0,335	170.243
	Clase ZGP	24/09/2021	GBP	0,279	21
	Clase ZUP	24/09/2021	USD	0,371	1.316
					<b>383.024 USD</b>

## 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)
<b>Threadneedle (Lux) - UK Equities</b>	Clase AGP	24/09/2021	GBP	0,375	29.513
	Clase IGP	24/09/2021	GBP	0,551	1.289.225
	Clase NGP	24/09/2021	GBP	0,225	13
	Clase TGP	24/09/2021	GBP	0,225	13
	Clase ZGP	24/09/2021	GBP	0,202	254.950
	Clase 9EP	24/09/2021	EUR	0,184	745.194
					<b>2.318.908 GBP</b>
<b>Threadneedle (Lux) - UK Equity Income</b>	Clase AEC	24/06/2021	EUR	0,115	6.432
	Clase AEC	24/09/2021	EUR	0,070	3.928
	Clase ASC	24/06/2021	SGD	0,119	11
	Clase ASC	24/09/2021	SGD	0,073	5
	Clase AUC	24/06/2021	USD	0,124	49.715
	Clase AUC	24/09/2021	USD	0,074	30.408
	Clase DEC	24/06/2021	EUR	0,111	11
	Clase DEC	24/09/2021	EUR	0,068	5
	Clase DGP	24/06/2021	GBP	0,120	12
	Clase DGP	24/09/2021	GBP	0,074	5
	Clase IGP	24/06/2021	GBP	0,124	155.152
	Clase IGP	24/09/2021	GBP	0,073	94.594
	Clase LGP	24/06/2021	GBP	0,125	1.131.701
	Clase LGP	24/09/2021	GBP	0,075	784.215
	Clase ZGP	24/06/2021	GBP	0,129	831
	Clase ZGP	24/09/2021	GBP	0,080	1.392
					<b>2.258.417 GBP</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities</b>	Clase IEP	24/06/2021	EUR	0,057	6
	Clase IEP	24/09/2021	EUR	0,061	5
	Clase LEP	24/06/2021	EUR	0,057	6
	Clase LEP	24/09/2021	EUR	0,061	5
					<b>22 EUR</b>

\* Cantidad fraccionada redondeada a 0.

## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 8 COMISIONES DE RENDIMIENTO

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Si al final del año calendario el saldo de comisiones sobre resultados es negativo y se ha superado el Valor Liquidativo Máximo, dicha cantidad negativa se transferirá y la Sociedad Gestora no recibirá el pago de una comisión sobre resultados hasta que el saldo de comisiones sobre resultados acumulado sea positivo y se haya excedido el Valor Liquidativo Máximo, al final de cualquier año calendario posterior.

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

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

A 30 de septiembre de 2021, las comisiones de rendimiento ascendían a 10.870 USD para Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha y a 668.299 EUR para Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha.



## Notas a los estados financieros

(continuación)

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

A 30 de septiembre de 2021, la SICAV tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	19/10/2021	USD	38.626	EUR	33.000	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	366
	19/10/2021	USD	14.105	SEK	123.148	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	26
	19/10/2021	EUR	13.495.090	USD	15.954.665	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(308.700)
	19/10/2021	EUR	17.288.196	USD	20.439.090	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(395.467)
	19/10/2021	SEK	8.710	USD	1.012	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17)
	19/10/2021	EUR	2.537.274	USD	2.999.711	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(58.040)
	19/10/2021	EUR	1.017.781	USD	1.203.279	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(23.282)
	19/10/2021	EUR	17.821.011	USD	21.069.015	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(407.656)
	19/10/2021	GBP	22.138.484	USD	30.677.209	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(826.031)
	19/10/2021	SEK	10.252.905	USD	1.191.616	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(19.504)
	19/10/2021	GBP	346.509	USD	480.156	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12.929)
	19/10/2021	EUR	20.709.136	USD	24.483.521	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(473.721)
	19/10/2021	EUR	1.201.871	USD	1.420.920	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(27.493)
	19/10/2021	GBP	12.828.958	USD	17.777.036	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(478.674)
	19/10/2021	GBP	115.538.418	USD	160.101.124	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.310.969)
	19/10/2021	EUR	23.354.631	USD	27.611.176	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(534.237)
	19/10/2021	GBP	2.357.197	USD	3.266.358	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(87.952)
	19/10/2021	EUR	2.043.893	USD	2.416.407	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(46.754)
	19/10/2021	GBP	108.381.219	USD	150.183.422	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.043.920)
	19/10/2021	NOK	8.704	USD	1.008	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
	19/10/2021	NOK	8.718	USD	1.010	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
	19/10/2021	CHF	941	USD	1.022	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13)
	19/10/2021	CHF	935	USD	1.016	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13)
	19/10/2021	EUR	856	USD	1.012	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20)
	19/10/2021	EUR	3.213	USD	3.798	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(72)
	19/10/2021	USD	6.206	EUR	5.251	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	118
	19/10/2021	USD	4.727	EUR	4.000	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	90
	19/10/2021	GBP	37.837	USD	52.405	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.387)
	19/10/2021	EUR	6.546	USD	7.744	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(154)
	19/10/2021	USD	510	EUR	431	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
	19/10/2021	USD	12.822	EUR	10.840	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	255
	19/10/2021	GBP	6.941	USD	9.616	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(256)
	19/10/2021	GBP	33.713	USD	46.703	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.244)
	19/10/2021	USD	17.836	EUR	15.082	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	350
19/10/2021	EUR	16.998	USD	20.102	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(395)	
19/10/2021	EUR	29.975	USD	35.448	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(696)	
19/10/2021	USD	192.066	GBP	138.877	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.806	
19/10/2021	GBP	6.900	USD	9.542	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(239)	
19/10/2021	USD	58.987	GBP	42.652	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.476	
19/10/2021	USD	47.985	EUR	40.769	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	719	
19/10/2021	EUR	2.391	USD	2.814	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(42)	
19/10/2021	USD	14.425	EUR	12.255	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	216	
19/10/2021	GBP	753.172	USD	1.037.184	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(21.619)	
19/10/2021	USD	342.665	GBP	248.833	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7.142	
19/10/2021	USD	23.045	EUR	19.624	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	293	
19/10/2021	EUR	224	USD	263	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)	
19/10/2021	USD	11.065	EUR	9.422	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	141	
19/10/2021	GBP	85.862	USD	118.042	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.267)	

## Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
<b>Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond</b> (continuación)	19/10/2021	GBP	3.467.698	USD	4.767.328	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(91.540)
	19/10/2021	USD	79.206	EUR	67.518	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	927
	19/10/2021	EUR	613	USD	719	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8)
	19/10/2021	USD	25.476	EUR	21.717	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	298
	19/10/2021	GBP	144.507	USD	197.552	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.701)
	19/10/2021	EUR	15.463	USD	18.140	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(212)
	19/10/2021	EUR	7.990	USD	9.372	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(109)
	19/10/2021	USD	127.430	EUR	108.633	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.482
	19/10/2021	EUR	4.215.253	USD	4.944.605	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(57.517)
	19/10/2021	GBP	4.951	USD	6.755	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(79)
	19/10/2021	GBP	108.650	USD	148.239	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.737)
	19/10/2021	EUR	3.437	USD	4.035	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(50)
	19/10/2021	USD	11.655	EUR	9.929	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	144
	19/10/2021	USD	190.781	GBP	139.806	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.269
	19/10/2021	USD	823.397	GBP	603.393	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9.792
	19/10/2021	USD	99.080	GBP	72.606	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.178
	19/10/2021	EUR	7.013	USD	8.232	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(101)
	19/10/2021	EUR	48.759	USD	57.313	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(783)
	19/10/2021	USD	122.054	EUR	103.838	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.666
	19/10/2021	USD	62.192	EUR	52.910	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	849
	19/10/2021	GBP	48.946	USD	67.276	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.279)
	19/10/2021	EUR	9.258	USD	10.882	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(149)
	19/10/2021	EUR	10.000	USD	11.754	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(161)
	19/10/2021	USD	247.071	EUR	210.928	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.524
	19/10/2021	USD	14.818	EUR	12.650	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	151
	19/10/2021	USD	1.941.382	GBP	1.419.914	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	26.793
	19/10/2021	USD	328.602	EUR	280.532	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.357
	19/10/2021	USD	34.427	GBP	25.180	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	475
	19/10/2021	USD	29.008	EUR	24.765	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	296
	19/10/2021	USD	31.853	EUR	27.183	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	338
	19/10/2021	EUR	2.619	USD	3.069	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(33)
	19/10/2021	USD	23.570	EUR	20.114	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	250
	19/10/2021	GBP	56.615	USD	77.427	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.088)
	19/10/2021	USD	11.858	GBP	8.671	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	167
	19/10/2021	GBP	115.903	USD	158.510	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.228)
	19/10/2021	EUR	11.057	USD	12.956	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(137)
	19/10/2021	USD	28.526	EUR	24.372	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	270
	19/10/2021	USD	22.675	EUR	19.373	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	215
	19/10/2021	EUR	123.990	USD	145.128	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.376)
	19/10/2021	GBP	65.956	USD	90.395	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.462)
	19/10/2021	EUR	3.911	USD	4.578	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(43)
	19/10/2021	USD	2.561.861	GBP	1.869.224	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	41.428
	19/10/2021	USD	2.956	GBP	2.167	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	34
	19/10/2021	USD	190.827	EUR	163.380	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.407
	19/10/2021	USD	12	SEK	106	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	36.737	EUR	31.453	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	271
	19/10/2021	USD	252.128	EUR	215.863	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.859
	19/10/2021	USD	352.374	GBP	260.356	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.313

## Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
<b>Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond</b> (continuación)								
	19/10/2021	USD	6.031	GBP	4.456	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	22
	19/10/2021	USD	354.471	EUR	303.486	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.614
	19/10/2021	USD	16.905	EUR	14.474	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	125
	19/10/2021	USD	196.146	GBP	144.925	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	731
	19/10/2021	USD	1.719.421	GBP	1.270.419	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6.408
	19/10/2021	USD	12	NOK	105	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	12	NOK	103	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	12	CHF	12	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	12	CHF	11	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	12	EUR	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	668	EUR	572	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
	19/10/2021	USD	57.106	EUR	48.902	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	409
	19/10/2021	EUR	48.474	USD	56.606	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(405)
	19/10/2021	GBP	5.007	USD	6.777	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(26)
	19/10/2021	GBP	80.749	USD	109.296	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(415)
	19/10/2021	EUR	23.888	USD	27.895	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(200)
	19/10/2021	USD	195.244	GBP	144.248	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	742
	19/10/2021	USD	1.407	GBP	1.042	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	19/10/2021	USD	21.611	EUR	18.600	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	46
	19/10/2021	USD	11.629	EUR	10.009	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	25
	19/10/2021	USD	4.278	GBP	3.187	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(19)
	19/10/2021	USD	10.020	GBP	7.464	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(44)
	19/10/2021	USD	34.555	GBP	25.739	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(151)
	29/10/2021	USD	4.516.659	CAD	5.719.838	Operaciones comerciales	Barclays	1.842
	29/10/2021	USD	96.960	AUD	133.668	Operaciones comerciales	Barclays	393
	29/10/2021	USD	1.482.096	JPY	165.150.467	Operaciones comerciales	Barclays	1.619
	29/10/2021	USD	68.533.532	GBP	50.432.601	Operaciones comerciales	Barclays	529.939
	29/10/2021	USD	188.834.508	EUR	161.582.780	Operaciones comerciales	Barclays	1.461.482
	29/10/2021	AUD	11.126	USD	8.060	Operaciones comerciales	Barclays	(22)
	29/10/2021	JPY	976.096	USD	8.769	Operaciones comerciales	Barclays	(18)
	29/10/2021	CAD	66.553	USD	52.494	Operaciones comerciales	Barclays	38
	29/10/2021	EUR	820.980	USD	957.812	Operaciones comerciales	Barclays	(5.800)
	29/10/2021	AUD	791	USD	569	Operaciones comerciales	Barclays	2
	29/10/2021	USD	1.446.923	EUR	1.250.000	Operaciones comerciales	Barclays	(2.582)
								<b>(10.134.058) USD</b>
<b>Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond</b>								
	19/10/2021	NOK	8.639	EUR	846	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	19/10/2021	NOK	8.652	EUR	847	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	19/10/2021	CHF	930	EUR	855	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/10/2021	CHF	935	EUR	858	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/10/2021	USD	1.025	EUR	867	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17
	19/10/2021	GBP	737	EUR	864	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
	27/10/2021	EUR	1.394.642	GBP	1.192.058	Operaciones comerciales	Barclays	8.454
	27/10/2021	EUR	7.136.050	USD	8.367.756	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(80.314)

## Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
<b>Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond</b>								
(continuación)	27/10/2021	EUR	7.234	GBP	6.182	Operaciones comerciales	Barclays	45
	27/10/2021	EUR	1.494.777	USD	1.750.000	Operaciones comerciales	Lloyds	(14.423)
	27/10/2021	EUR	797.329	USD	930.000	Operaciones comerciales	Barclays	(4.702)
								<b>(90.902) EUR</b>
<b>Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond</b>								
	19/10/2021	SEK	8.648	EUR	850	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	19/10/2021	SEK	8.646	EUR	849	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	19/10/2021	USD	3.032.836	EUR	2.565.294	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	50.614
	19/10/2021	CHF	364.689	EUR	334.970	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.391
	19/10/2021	CHF	133.290	EUR	122.428	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	874
	19/10/2021	CHF	440.915	EUR	404.984	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.890
	19/10/2021	CHF	76.991	EUR	70.717	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	505
	19/10/2021	CHF	945	EUR	868	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/10/2021	CHF	26.070	EUR	23.946	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	171
	19/10/2021	NOK	8.671	EUR	849	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	19/10/2021	NOK	8.685	EUR	850	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	27/10/2021	EUR	6.960.118	USD	8.160.102	Operaciones comerciales	Barclays	(77.162)
	27/10/2021	EUR	72.808.226	GBP	62.274.470	Operaciones comerciales	Barclays	392.176
	27/10/2021	USD	2.000.000	EUR	1.709.200	Operaciones comerciales	Lloyds	15.592
	27/10/2021	GBP	1.250.000	EUR	1.448.538	Operaciones comerciales	Lloyds	5.032
	27/10/2021	GBP	633.460	EUR	732.589	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	4.033
	27/10/2021	GBP	1.000.000	EUR	1.162.731	Operaciones comerciales	Lloyds	125
								<b>397.269 EUR</b>
<b>Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond</b>								
	19/10/2021	SEK	8.615	EUR	846	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	19/10/2021	NOK	8.721	EUR	854	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	19/10/2021	GBP	747	EUR	876	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
	19/10/2021	GBP	806	EUR	945	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
	19/10/2021	GBP	74.253.586	EUR	87.030.846	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(672.440)
	19/10/2021	SEK	8.642	EUR	849	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	19/10/2021	NOK	8.669	EUR	849	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	19/10/2021	GBP	7.284.168	EUR	8.537.598	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(65.965)
	27/10/2021	EUR	21.963.520	GBP	18.785.880	Operaciones comerciales	Barclays	118.305
	27/10/2021	EUR	234.135	USD	275.000	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(3.026)
								<b>(623.118) EUR</b>
<b>Threadneedle (Lux) - European Social Bond</b>								
	19/10/2021	GBP	5.458		6.386	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(38)
	19/10/2021	GBP	111.495		130.445	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(775)
	19/10/2021	GBP	17.468		20.449	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(134)
	19/10/2021	GBP	30.394		35.582	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(233)
	19/10/2021	GBP	6.021		7.016	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)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
<b>Threadneedle (Lux) - European Social Bond</b> (continuación)								
	19/10/2021	GBP	80.936		94.320	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(190)
	19/10/2021	GBP	30.950		35.998	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/10/2021	GBP	24.297		28.260	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/10/2021	GBP	7.317		8.506	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
	19/10/2021	GBP	30.255		35.171	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	16
	19/10/2021	GBP	11.878		13.890	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(75)
	19/10/2021	GBP	75.924		88.783	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(482)
	19/10/2021	GBP	12.637		14.748	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(51)
	19/10/2021	GBP	37.755		44.062	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(153)
	19/10/2021	GBP	16.087		18.836	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(127)
	19/10/2021	GBP	179.260		209.899	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.415)
	19/10/2021	GBP	4.657		5.398	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	18
	19/10/2021	GBP	109.504		126.928	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	427
	19/10/2021	GBP	37.073		42.838	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	279
	19/10/2021	GBP	26.563		30.694	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	200
	19/10/2021	CHF	21.364.949		19.623.879	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	140.054
	19/10/2021	CHF	375.064		344.500	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.459
	19/10/2021	GBP	5.622.028		6.589.444	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(50.914)
	19/10/2021	SEK	8.641		849	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	19/10/2021	NOK	8.672		849	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	19/10/2021	GBP	22.585.023		26.471.363	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(204.531)
	19/10/2021	USD	15.576		13.175	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	260
	19/10/2021	NOK	8.674		849	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	19/10/2021	SEK	8.634		848	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	19/10/2021	CHF	933		857	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/10/2021	USD	1.008		853	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17
	19/10/2021	USD	1.004		849	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17
	19/10/2021	SGD	1.007		634	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/10/2021	SGD	1.004		632	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/10/2021	USD	1.009		853	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17
	19/10/2021	USD	274.838		232.469	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.587
	19/10/2021	SGD	1.007		634	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/10/2021	SGD	1.004		632	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/10/2021	GBP	3.537		4.145	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(32)
	19/10/2021	EUR	12.262		13.335	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(73)
	19/10/2021	GBP	6.369		7.465	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(57)
	19/10/2021	GBP	33.752		39.557	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(303)
	19/10/2021	CHF	49.401		45.457	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	242
	19/10/2021	GBP	5.562		6.514	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(45)
	19/10/2021	GBP	17.093		19.989	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(110)
	19/10/2021	GBP	11.089		12.969	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(71)
	20/10/2021	EUR	19.733.352		23.230.035	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(302.954)
	20/10/2021	SEK	34.760		3.422	Operaciones comerciales	HSBC	5
	20/10/2021	CAD	1.881		1.252	Operaciones comerciales	HSBC	29
	20/10/2021	GBP	161.284		188.408	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(835)

## Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
<b>Threadneedle (Lux) - European Social Bond</b> (continuación)								
	20/10/2021	EUR	298.118		350.000	Operaciones comerciales	HSBC	(3.763)
	20/10/2021	EUR	291.526		250.000	Operaciones comerciales	HSBC	777
	20/10/2021	EUR	291.072		250.000	Operaciones comerciales	HSBC	322
	20/10/2021	EUR	328.692		281.580	Operaciones comerciales	HSBC	1.216
	20/10/2021	EUR	121.111		103.490	Operaciones comerciales	HSBC	753
	20/10/2021	CAD	1.512		1.021	Operaciones comerciales	HSBC	8
	20/10/2021	EUR	170.931		200.000	Operaciones comerciales	HSBC	(1.572)
	20/10/2021	USD	1.975.000		1.687.130	Operaciones comerciales	HSBC	16.330
	20/10/2021	SEK	1.974.190		193.890	Operaciones comerciales	HSBC	772
	20/10/2021	GBP	198.462		231.336	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(525)
	20/10/2021	GBP	750.000		869.199	Operaciones comerciales	HSBC	3.050
	20/10/2021	USD	209.550		179.414	Operaciones comerciales	HSBC	1.325
	20/10/2021	CAD	299.807		202.029	Operaciones comerciales	HSBC	2.084
	20/10/2021	EUR	40		60	Operaciones comerciales	HSBC	0
	20/10/2021	EUR	86.265		100.000	Operaciones comerciales	HSBC	14
	20/10/2021	EUR	585.654		5.952.539	Operaciones comerciales	HSBC	(1.286)
	20/10/2021	EUR	32.664.851		27.919.651	Operaciones comerciales	HSBC	194.395
	20/10/2021	EUR	203.048		303.201	Operaciones comerciales	HSBC	(3.377)
								<b>(204.410) EUR</b>
<b>Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond</b>								
	19/10/2021	USD	1.013	EUR	857	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17
	19/10/2021	USD	1.005	EUR	850	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17
	19/10/2021	SEK	8.632	EUR	848	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	19/10/2021	NOK	8.637	EUR	846	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	19/10/2021	NOK	8.657	EUR	847	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	15/10/2021	EUR	35.525.245	USD	41.668.292	Operaciones comerciales	Barclays	(417.757)
	15/10/2021	EUR	109.799	AUD	175.664	Operaciones comerciales	Lloyds	336
	15/10/2021	EUR	34.437.622	GBP	29.220.897	Operaciones comerciales	Barclays	450.862
	15/10/2021	EUR	725.314	GBP	619.268	Operaciones comerciales	Barclays	5.044
	15/10/2021	EUR	96.801	USD	113.966	Operaciones comerciales	Lloyds	(1.506)
	15/10/2021	EUR	53.907	USD	63.868	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(1.186)
	15/10/2021	EUR	80.994	GBP	69.582	Operaciones comerciales	Lloyds	63
	15/10/2021	EUR	2.188.808	USD	2.592.279	Operaciones comerciales	HSBC	(47.294)
	15/10/2021	EUR	96.969	USD	114.578	Operaciones comerciales	HSBC	(1.866)
	15/10/2021	EUR	90.006	GBP	76.766	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	719
	15/10/2021	EUR	1.202.865	GBP	1.023.894	Operaciones comerciales	Lloyds	11.975
	15/10/2021	USD	272.856	EUR	233.848	Operaciones comerciales	HSBC	1.516
	15/10/2021	EUR	56.166	GBP	48.506	Operaciones comerciales	Lloyds	(251)
								<b>708 EUR</b>

## Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market</b>								
<b>Corporate Bonds</b>	19/10/2021	EUR	6.159.399	USD	7.281.992	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(140.895)
	19/10/2021	EUR	2.586.318	USD	3.057.692	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(59.162)
	19/10/2021	EUR	13.255.515	USD	15.671.425	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(303.219)
	19/10/2021	SGD	125.272	USD	93.281	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.010)
	19/10/2021	EUR	6.387.733	USD	7.551.942	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(146.119)
	19/10/2021	EUR	164.313	USD	194.260	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.759)
	19/10/2021	EUR	502.942	USD	594.607	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11.505)
	19/10/2021	SEK	8.676	USD	1.008	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17)
	19/10/2021	NOK	8.673	USD	1.005	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
	19/10/2021	EUR	3.006.989	USD	3.555.033	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(68.785)
	19/10/2021	EUR	3.025	USD	3.575	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(68)
	19/10/2021	USD	650	EUR	549	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
	19/10/2021	EUR	4.487	USD	5.307	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(106)
	19/10/2021	EUR	5.200	USD	6.151	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(122)
	19/10/2021	EUR	190	USD	225	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
	19/10/2021	USD	6.065	EUR	5.128	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	119
	19/10/2021	USD	30.123	EUR	25.472	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	591
	19/10/2021	EUR	500	USD	589	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
	19/10/2021	USD	21.750	EUR	18.479	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	326
	19/10/2021	USD	102	EUR	86	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	19/10/2021	EUR	2.941	USD	3.462	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(52)
	19/10/2021	USD	20	EUR	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	1.451	USD	1.704	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(22)
	19/10/2021	EUR	3.787	USD	4.447	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(57)
	19/10/2021	EUR	8.000	USD	9.395	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(120)
	19/10/2021	USD	94.525	EUR	80.577	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.106
	19/10/2021	USD	3.139	EUR	2.675	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	37
	19/10/2021	USD	23.624	EUR	20.139	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	275
	19/10/2021	USD	20.230	EUR	17.246	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	235
	19/10/2021	USD	6.335	EUR	5.397	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	78
	19/10/2021	EUR	34.861	USD	40.922	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(505)
	19/10/2021	EUR	5.245	USD	6.157	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(76)
	19/10/2021	USD	5.966	EUR	5.075	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	81
	19/10/2021	USD	1.123	EUR	955	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15
	19/10/2021	USD	213	EUR	182	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	19/10/2021	EUR	56.898	USD	66.673	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(707)
	19/10/2021	USD	78.614	EUR	67.288	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	602
	19/10/2021	USD	5.857	EUR	5.013	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	45
	19/10/2021	USD	36.017	EUR	30.828	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	276
	19/10/2021	USD	120	EUR	102	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2021	USD	71.255	EUR	61.006	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	525
	19/10/2021	USD	29.396	EUR	25.168	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	217

## Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds</b> (continuación)								
	19/10/2021	USD	17.356	EUR	14.862	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	124
	19/10/2021	EUR	10.530	USD	12.297	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(88)
	19/10/2021	USD	9.494	EUR	8.130	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	68
	19/10/2021	USD	11.275	EUR	9.656	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	81
	19/10/2021	USD	3.020	EUR	2.600	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/10/2021	EUR	6.539	USD	7.598	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(16)
	19/10/2021	EUR	4	USD	4	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
								<b>(731.609) USD</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt</b>								
	19/10/2021	EUR	262.977	USD	310.906	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6.016)
	19/10/2021	EUR	465.316	USD	550.123	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10.643)
	19/10/2021	EUR	675.715	USD	798.869	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(15.456)
	19/10/2021	EUR	670.510	USD	792.715	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(15.338)
	19/10/2021	SGD	66.641	USD	49.623	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(537)
	19/10/2021	SEK	8.703	USD	1.012	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17)
	19/10/2021	NOK	8.741	USD	1.012	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
	19/10/2021	USD	1.188	EUR	1.004	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	23
	19/10/2021	SGD	2.089	USD	1.546	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
	19/10/2021	USD	1.052	EUR	895	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	14
	19/10/2021	USD	4.737	EUR	4.044	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	48
	19/10/2021	USD	8.344	EUR	7.123	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	85
	19/10/2021	USD	11.960	EUR	10.210	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	122
	19/10/2021	USD	15.107	EUR	12.897	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	154
	19/10/2021	USD	761	SGD	1.030	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	19/10/2021	USD	15	SEK	133	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	15	NOK	132	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	250	USD	292	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/10/2021	EUR	106	USD	124	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	27/10/2021	USD	119.534	EUR	102.256	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	961
	27/10/2021	USD	991.113	EUR	847.876	Operaciones comerciales	HSBC	7.947
	27/10/2021	USD	490.650	MXN	10.095.000	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	1.361
								<b>(37.310) USD</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds</b>								
	19/10/2021	EUR	1.584.291	USD	1.873.039	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(36.241)
	19/10/2021	EUR	2.852.926	USD	3.372.891	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(65.261)
	19/10/2021	EUR	12.810.905	USD	15.145.782	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(293.049)
	19/10/2021	EUR	13.608.931	USD	16.089.254	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(311.304)
	19/10/2021	SGD	240.825	USD	179.326	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.942)
	19/10/2021	SGD	1.014.540	USD	755.456	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8.182)
	19/10/2021	SEK	8.688	USD	1.010	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17)
	19/10/2021	EUR	243.505	USD	287.885	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5.570)



## Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
<b>Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds</b> (continuación)								
	19/10/2021	NOK	8.655	USD	1.002	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
	19/10/2021	USD	10.543	EUR	8.915	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	207
	19/10/2021	SGD	497	USD	370	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
	19/10/2021	USD	20.729	EUR	17.670	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	243
	19/10/2021	EUR	4.990	USD	5.854	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(69)
	19/10/2021	USD	3.287	EUR	2.802	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	38
	19/10/2021	USD	188.227	EUR	160.693	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.923
	19/10/2021	USD	8.657	SGD	11.715	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	28
	19/10/2021	USD	129	EUR	110	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2021	SGD	5.400	USD	3.988	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10)
	19/10/2021	EUR	10.990	USD	12.864	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(122)
	19/10/2021	USD	20.390	EUR	17.457	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	150
	19/10/2021	USD	37.029	EUR	31.703	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	273
	19/10/2021	USD	161.378	EUR	138.166	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.190
	19/10/2021	USD	1.916	SGD	2.601	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2021	USD	11	SEK	96	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	3.074	EUR	2.632	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	23
	19/10/2021	USD	11	NOK	94	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	12.543	EUR	10.742	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	90
	19/10/2021	EUR	515	USD	598	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2021	SGD	12	USD	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
								<b>(717.617) USD</b>
<b>Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond</b>								
	19/10/2021	EUR	787.864	USD	931.458	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(18.022)
	19/10/2021	EUR	685.816	USD	810.810	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(15.688)
	19/10/2021	EUR	66.317.048	USD	78.403.795	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.517.002)
	19/10/2021	SGD	612.489	USD	456.077	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.939)
	19/10/2021	EUR	371.880	USD	439.658	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8.507)
	19/10/2021	EUR	284.181	USD	335.975	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6.501)
	19/10/2021	SEK	8.637	USD	1.004	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(16)
	19/10/2021	SEK	8.680	USD	1.009	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17)
	19/10/2021	CHF	939	USD	1.020	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13)
	19/10/2021	GBP	734	USD	1.017	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(27)
	19/10/2021	EUR	42.608	USD	50.374	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(975)
	19/10/2021	EUR	853	USD	1.008	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20)
	19/10/2021	NOK	8.693	USD	1.007	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
	19/10/2021	NOK	8.710	USD	1.009	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
	19/10/2021	SGD	1.359	USD	1.012	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
	19/10/2021	USD	9.640	EUR	8.157	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	183
	19/10/2021	USD	159	EUR	135	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	19/10/2021	SGD	337	USD	251	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
	19/10/2021	USD	17.502	EUR	14.796	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	348
	19/10/2021	SGD	200	USD	149	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/10/2021	SGD	258	USD	193	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)

## Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
<b>Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond</b> <i>(continuación)</i>								
	19/10/2021	EUR	34	USD	40	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2021	USD	37.632	EUR	32.046	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	479
	19/10/2021	SGD	9	USD	6	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	35.512	EUR	30.272	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	415
	19/10/2021	USD	5.037	SGD	6.807	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	23
	19/10/2021	EUR	235	USD	276	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
	19/10/2021	SGD	1.028	USD	760	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
	19/10/2021	SGD	10	USD	8	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	SGD	5.625	USD	4.176	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(33)
	19/10/2021	USD	13.029	EUR	11.119	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	138
	19/10/2021	SGD	500	USD	369	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2021	USD	2.678	EUR	2.288	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	25
	19/10/2021	EUR	2.182	USD	2.554	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(24)
	19/10/2021	SGD	1.009	USD	745	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/10/2021	USD	4.580	EUR	3.922	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	34
	19/10/2021	USD	3.545	EUR	3.035	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	26
	19/10/2021	USD	10	EUR	9	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	10	SGD	14	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
								<b>(1.570.160) USD</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond</b>								
	19/10/2021	EUR	1.253.270	USD	1.481.687	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(28.669)
	19/10/2021	SGD	492.794	USD	366.949	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.974)
	19/10/2021	SGD	34.473	USD	25.670	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(278)
	19/10/2021	EUR	572.069	USD	676.333	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13.086)
	19/10/2021	EUR	14.392.691	USD	17.015.859	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(329.233)
	19/10/2021	GBP	735	USD	1.018	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(27)
	19/10/2021	SGD	1.376	USD	1.025	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
	19/10/2021	AUD	1.194	USD	876	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13)
	19/10/2021	AUD	1.052	USD	771	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12)
	19/10/2021	SEK	8.671	USD	1.008	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17)
	19/10/2021	EUR	103.315	USD	122.096	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.314)
	19/10/2021	USD	1	SGD	2	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	568	USD	672	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13)
	19/10/2021	EUR	1.976	USD	2.336	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(46)
	19/10/2021	SGD	355	USD	265	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
	19/10/2021	USD	45.460	EUR	38.441	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	892
	19/10/2021	USD	11.282	EUR	9.540	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	221
	19/10/2021	SGD	746	USD	554	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
	19/10/2021	EUR	6.781	USD	7.981	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(120)
	19/10/2021	USD	8	SGD	11	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	6.687	USD	7.853	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(100)
	19/10/2021	SGD	70	USD	52	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	1.487	USD	1.744	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20)
	19/10/2021	USD	34.929	EUR	29.777	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	406
	19/10/2021	EUR	50.290	USD	58.991	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(686)

## Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
<b>Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond</b> (continuación)								
	19/10/2021	EUR	9.632	USD	11.306	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(139)
	19/10/2021	USD	1.278	EUR	1.087	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17
	19/10/2021	USD	8	AUD	11	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	149	USD	175	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/10/2021	EUR	1.853	USD	2.172	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(23)
	19/10/2021	USD	267	SGD	362	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2021	SGD	2.704	USD	1.997	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
	19/10/2021	USD	470	EUR	401	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
	19/10/2021	USD	14.223	EUR	12.178	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	105
	19/10/2021	SGD	854	USD	629	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	9.345	USD	10.913	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(78)
	19/10/2021	USD	3.954	SGD	5.385	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12)
	19/10/2021	USD	7.008	EUR	6.040	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/10/2021	USD	184.865	EUR	159.309	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	166
	19/10/2021	USD	11	GBP	8	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	11	SGD	15	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	9	AUD	13	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	11	SEK	96	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	SGD	2.179	USD	1.602	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
	19/10/2021	SGD	11	USD	8	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	43.817	EUR	37.712	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	94
	27/10/2021	USD	1.679.973	CNY	10.985.618	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(18.456)
	27/10/2021	USD	362.621	KRW	429.350.775	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	13
	27/10/2021	USD	1.516.268	SGD	2.067.860	Operaciones comerciales	UBS	(6.821)
	27/10/2021	PHP	24.131.185	USD	476.101	Operaciones comerciales	Barclays	(5.060)
	27/10/2021	MYR	1.265.571	USD	297.943	Operaciones comerciales	Barclays	3.902
	27/10/2021	USD	903.230	THB	30.172.944	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	11.622
	27/10/2021	KRW	429.350.775	USD	367.686	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(5.078)
								<b>(396.849) USD</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return</b>								
	23/12/2021	AUD	1.030.000	EUR	636.186	Operaciones comerciales	Barclays	4.855
	23/12/2021	EUR	471.349	USD	553.000	Operaciones comerciales	Barclays	(4.896)
	23/12/2021	JPY	85.065.000	EUR	656.393	Operaciones comerciales	Barclays	773
	23/12/2021	EUR	2.074.117	GBP	1.780.000	Operaciones comerciales	Barclays	6.767
								<b>7.499 EUR</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return</b>								
	19/10/2021	EUR	9.641.211	USD	11.398.389	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(220.542)
	19/10/2021	EUR	2.294.913	USD	2.713.176	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(52.495)
	19/10/2021	EUR	929.399	USD	1.098.788	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(21.260)
	19/10/2021	GBP	374.096	USD	518.383	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13.958)
	19/10/2021	EUR	860	USD	1.017	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20)
	19/10/2021	SEK	8.674	USD	1.008	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17)
	19/10/2021	EUR	158	USD	187	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)

## Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
<b>Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return</b>								
(continuación)	19/10/2021	EUR	4.496	USD	5.291	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(79)
	19/10/2021	EUR	9.988	USD	11.756	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(176)
	19/10/2021	USD	35	EUR	30	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	30	USD	35	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	149	USD	175	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/10/2021	USD	267.450	EUR	228.982	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.972
	19/10/2021	USD	64.607	EUR	55.314	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	476
	19/10/2021	USD	26.876	EUR	23.010	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	198
	19/10/2021	USD	11.858	GBP	8.762	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	44
	19/10/2021	USD	24	EUR	20	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	23	SEK	204	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	171	EUR	146	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2021	EUR	61	USD	71	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	23/12/2021	AUD	1.480.000	USD	1.072.535	Operaciones comerciales	UBS	(2.953)
	23/12/2021	JPY	464.140.000	USD	4.201.855	Operaciones comerciales	Barclays	(38.175)
								<b>(346.990) USD</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income</b>								
	19/10/2021	EUR	14.532.354	USD	17.180.978	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(332.428)
	19/10/2021	SGD	7.317	USD	5.449	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(59)
	19/10/2021	EUR	210.140	USD	248.440	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.807)
	19/10/2021	CHF	941	USD	1.022	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13)
	19/10/2021	EUR	43.871.202	USD	51.867.036	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.003.553)
	19/10/2021	EUR	23.278.390	USD	27.521.039	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(532.493)
	19/10/2021	EUR	856	USD	1.013	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20)
	19/10/2021	EUR	2.835.028	USD	3.351.732	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(64.851)
	19/10/2021	SGD	175.569	USD	130.734	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.416)
	19/10/2021	USD	14.548	EUR	12.310	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	276
	19/10/2021	USD	132	EUR	112	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	19/10/2021	USD	2.339	EUR	1.977	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	46
	19/10/2021	USD	23.699	EUR	20.035	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	471
	19/10/2021	USD	33.428	EUR	28.259	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	664
	19/10/2021	USD	6.500	EUR	5.495	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	129
	19/10/2021	USD	7.509	EUR	6.350	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	147
	19/10/2021	EUR	25	USD	30	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2021	USD	46.033	EUR	38.926	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	903
	19/10/2021	EUR	17.099	USD	20.126	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(301)
	19/10/2021	USD	42.307	EUR	35.945	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	634
	19/10/2021	USD	12.018	EUR	10.210	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	180
	19/10/2021	USD	508	EUR	432	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/10/2021	USD	283.094	EUR	241.069	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.602
	19/10/2021	USD	4.950	EUR	4.215	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	63
	19/10/2021	EUR	25.867	USD	30.345	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(355)
	19/10/2021	USD	48.939	EUR	41.717	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	573
	19/10/2021	EUR	12.110	USD	14.207	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(166)

## Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
<b>Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income</b> (continuación)								
	19/10/2021	SGD	95.879	USD	70.948	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(326)
	19/10/2021	USD	8.538	EUR	7.279	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	99
	19/10/2021	USD	91.502	EUR	78.005	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.064
	19/10/2021	USD	19.559	EUR	16.674	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	227
	19/10/2021	USD	39.767	EUR	33.877	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	490
	19/10/2021	USD	16.661	EUR	14.193	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	205
	19/10/2021	EUR	2.000	USD	2.351	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(32)
	19/10/2021	USD	15.537	EUR	13.218	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	212
	19/10/2021	USD	1.058.224	EUR	903.422	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10.809
	19/10/2021	USD	567.072	EUR	484.118	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5.792
	19/10/2021	USD	21	EUR	18	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	24.936	EUR	21.280	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	264
	19/10/2021	EUR	6.716	USD	7.870	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(83)
	19/10/2021	SGD	276	USD	204	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2021	USD	19	EUR	16	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	26.375	EUR	22.534	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	250
	19/10/2021	EUR	99	USD	115	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2021	USD	25.369	EUR	21.674	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	240
	19/10/2021	USD	4.799	SGD	6.512	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	19/10/2021	USD	13.917	EUR	11.918	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	100
	19/10/2021	USD	54.358	EUR	46.550	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	389
	19/10/2021	USD	3.503	EUR	3.015	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	19/10/2021	USD	18.534	EUR	15.952	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	40
	19/10/2021	USD	3.738	EUR	3.217	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	19/10/2021	SGD	1.517	USD	1.115	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	15/10/2021	KRW	79.491.132	USD	69.009	Operaciones comerciales	HSBC	(1.860)
	15/10/2021	CNY	2.861.417	USD	438.670	Operaciones comerciales	UBS	4.149
	15/10/2021	NOK	65.310	USD	7.312	Operaciones comerciales	HSBC	169
	15/10/2021	CHF	29.846	USD	32.368	Operaciones comerciales	HSBC	(362)
	15/10/2021	NZD	14.125	USD	9.881	Operaciones comerciales	HSBC	(138)
	15/10/2021	MXN	2.280.395	USD	112.650	Operaciones comerciales	Barclays	(1.935)
	15/10/2021	AUD	55.892	USD	40.982	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(606)
	15/10/2021	SEK	215.418	USD	24.715	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(89)
	15/10/2021	JPY	56.276.723	USD	508.206	Operaciones comerciales	HSBC	(3.769)
	15/10/2021	USD	78.071	GBP	56.493	Operaciones comerciales	HSBC	1.897
	15/10/2021	EUR	360.392	USD	422.549	Operaciones comerciales	Barclays	(4.749)
	15/10/2021	USD	188.098	ZAR	2.814.350	Operaciones comerciales	UBS	1.437
	15/10/2021	CAD	30.880	USD	24.641	Operaciones comerciales	Lloyds	(266)
	15/10/2021	JPY	327.545	USD	2.968	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	(32)
	15/10/2021	USD	3.393	GBP	2.454	Operaciones comerciales	HSBC	84
	15/10/2021	CNY	32.448	USD	4.984	Operaciones comerciales	UBS	38
	15/10/2021	USD	2.285	JPY	249.504	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	49
	15/10/2021	USD	1.953	AUD	2.624	Operaciones comerciales	Barclays	57
	15/10/2021	RUB	793.606	USD	10.818	Operaciones comerciales	HSBC	64
	15/10/2021	IDR	355.453.455	USD	24.949	Operaciones comerciales	HSBC	(152)
	15/10/2021	USD	3.784	CNY	24.481	Operaciones comerciales	HSBC	(5)

## Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
<b>Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income</b> (continuación)								
	15/10/2021	THB	602.030	USD	18.567	Operaciones comerciales	HSBC	(776)
	15/10/2021	KRW	2.440.615	USD	2.110	Operaciones comerciales	Barclays	(49)
	15/10/2021	USD	11.550	ZAR	165.566	Operaciones comerciales	UBS	570
	15/10/2021	SGD	16.213	USD	12.078	Operaciones comerciales	UBS	(136)
	15/10/2021	USD	4.490	MXN	89.878	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	127
	15/10/2021	JPY	251.188	USD	2.286	Operaciones comerciales	Lloyds	(34)
	15/10/2021	EUR	14.604	USD	17.295	Operaciones comerciales	HSBC	(365)
	15/10/2021	GBP	6.622	USD	9.115	Operaciones comerciales	Barclays	(186)
	15/10/2021	USD	12.991	EUR	10.970	Operaciones comerciales	Barclays	274
	15/10/2021	USD	2.726	EUR	2.305	Operaciones comerciales	HSBC	53
	15/10/2021	USD	16.999	EUR	14.431	Operaciones comerciales	HSBC	269
	15/10/2021	EUR	80.696	USD	94.712	Operaciones comerciales	UBS	(1.162)
	15/10/2021	USD	16.380	GBP	11.994	Operaciones comerciales	UBS	208
	15/10/2021	GBP	47.666	USD	65.106	Operaciones comerciales	HSBC	(835)
	27/10/2021	USD	5.998.011	GBP	4.375.523	Operaciones comerciales	Barclays	98.048
	27/10/2021	USD	37.676.516	EUR	32.133.489	Operaciones comerciales	Lloyds	415.590
	15/10/2021	USD	61.202	GBP	44.657	Operaciones comerciales	HSBC	988
	15/10/2021	USD	1.656	EUR	1.414	Operaciones comerciales	Lloyds	17
	15/10/2021	ZAR	57.174	USD	3.810	Operaciones comerciales	UBS	(17)
	23/12/2021	USD	3.439.464	GBP	2.515.000	Operaciones comerciales	Lloyds	47.591
	27/10/2021	EUR	99.043	USD	115.898	Operaciones comerciales	Barclays	(1.053)
	29/10/2021	USD	99.693	CAD	126.260	Operaciones comerciales	Lloyds	33
	29/10/2021	USD	5.498.337	EUR	4.702.054	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	45.786
	29/10/2021	USD	30.500	JPY	3.398.553	Operaciones comerciales	Lloyds	34
	29/10/2021	USD	1.474.652	GBP	1.085.209	Operaciones comerciales	Lloyds	11.350
	27/10/2021	GBP	13.137	USD	17.763	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(49)
	27/10/2021	EUR	90.226	USD	105.260	Operaciones comerciales	Barclays	(637)
	29/10/2021	JPY	20.080	USD	180	Operaciones comerciales	Barclays	0
	29/10/2021	CAD	2.270	USD	1.791	Operaciones comerciales	Barclays	1
	15/10/2021	USD	93.389	GBP	69.149	Operaciones comerciales	HSBC	150
	29/10/2021	CAD	847	USD	665	Operaciones comerciales	HSBC	4
	29/10/2021	USD	67.414	GBP	50.000	Operaciones comerciales	HSBC	(7)
								<b>(1.303.239) USD</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities</b>								
	19/10/2021	EUR	1.296	USD	1.532	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(30)
	19/10/2021	EUR	114.639	USD	135.533	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.622)
	19/10/2021	EUR	1.312	USD	1.551	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(30)
	19/10/2021	EUR	1.310	USD	1.549	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(30)
	19/10/2021	EUR	1.306	USD	1.544	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(30)
	19/10/2021	USD	66	EUR	56	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2021	USD	5.809	EUR	4.950	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	70
	19/10/2021	USD	66	EUR	56	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2021	USD	66	EUR	56	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2021	USD	66	EUR	56	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1

## Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities</b> <i>(continuación)</i>								
	19/10/2021	EUR	31	USD	37	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	2.779	USD	3.263	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(41)
	19/10/2021	EUR	32	USD	37	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	32	USD	37	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	32	USD	37	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	62	EUR	53	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	4.874	EUR	4.173	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	36
	19/10/2021	USD	56	EUR	48	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	56	EUR	48	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	63	EUR	54	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
								<b>(2.673) USD</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Global Focus</b>								
	19/10/2021	EUR	52.678.576	USD	62.279.615	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.205.022)
	19/10/2021	EUR	57.792	USD	68.324	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.322)
	19/10/2021	CHF	1.403.306	USD	1.524.239	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(19.191)
	19/10/2021	EUR	175.729	USD	207.673	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.936)
	19/10/2021	EUR	139.470	USD	164.823	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.124)
	19/10/2021	EUR	20.406	USD	24.116	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(457)
	19/10/2021	EUR	19.271	USD	22.795	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(453)
	19/10/2021	EUR	78.514	USD	92.874	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.847)
	19/10/2021	USD	11.510	EUR	9.731	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	229
	19/10/2021	EUR	200.578	USD	237.203	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.656)
	19/10/2021	USD	13.954	EUR	11.800	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	274
	19/10/2021	EUR	379.476	USD	448.766	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8.809)
	19/10/2021	EUR	81.089	USD	95.443	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.430)
	19/10/2021	USD	7.289	EUR	6.193	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	109
	19/10/2021	EUR	104.464	USD	122.956	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.842)
	19/10/2021	EUR	15.253	USD	17.912	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(228)
	19/10/2021	EUR	21.765	USD	25.559	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(325)
	19/10/2021	USD	2.357.689	EUR	2.008.918	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	28.575
	19/10/2021	USD	394.596	EUR	336.224	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.782
	19/10/2021	USD	1.259.179	EUR	1.072.910	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15.261
	19/10/2021	USD	1.367	EUR	1.165	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17
	19/10/2021	USD	30.459	CHF	28.239	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	173
	19/10/2021	EUR	558.505	USD	655.189	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7.668)
	19/10/2021	EUR	5.075	USD	5.954	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(70)
	19/10/2021	EUR	2.386	USD	2.799	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(33)
	19/10/2021	EUR	68.972	USD	80.906	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(941)
	19/10/2021	EUR	33.024	USD	38.738	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(451)
	19/10/2021	EUR	161.792	USD	189.786	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.208)
	19/10/2021	USD	49.720	EUR	42.356	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	613
	19/10/2021	EUR	23.301	USD	27.352	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(337)
	19/10/2021	EUR	101.154	USD	118.900	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.624)
	19/10/2021	EUR	109.965	USD	129.256	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.765)
	19/10/2021	EUR	2.000	USD	2.351	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(32)

## Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
<b>Threadneedle (Lux) - Global Focus</b>								
<i>(continuación)</i>	19/10/2021	EUR	317.500	USD	372.047	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.944)
	19/10/2021	EUR	19.990	USD	23.424	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(248)
	19/10/2021	EUR	717.977	USD	841.328	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8.919)
	19/10/2021	EUR	22.097	USD	25.864	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(245)
	19/10/2021	EUR	100.182	USD	117.261	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.112)
	19/10/2021	EUR	757	USD	886	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8)
	19/10/2021	USD	3.257.773	EUR	2.789.196	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	24.021
	19/10/2021	USD	549.035	EUR	470.065	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.048
	19/10/2021	USD	1.759.337	EUR	1.506.285	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12.972
	19/10/2021	USD	1.870	EUR	1.601	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	14
	19/10/2021	USD	41.860	CHF	38.913	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	126
	19/10/2021	USD	1.338	EUR	1.145	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
	19/10/2021	EUR	17.373	USD	20.287	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(145)
	19/10/2021	EUR	98.411.098	USD	116.347.210	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.251.154)
	19/10/2021	EUR	16.226.106	USD	19.183.427	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(371.172)
	19/10/2021	USD	1.767.407	EUR	1.513.521	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12.653
	19/10/2021	EUR	60.417	USD	70.197	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(150)
	19/10/2021	EUR	4.447	USD	5.167	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
	19/10/2021	EUR	476.114	USD	553.182	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.184)
								<b>(3.802.186) USD</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities</b>								
	19/10/2021	EUR	959.886	USD	1.134.832	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(21.957)
	19/10/2021	EUR	1.482.074	USD	1.752.192	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(33.903)
	19/10/2021	EUR	651.798	USD	770.593	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14.910)
	19/10/2021	EUR	1.500	USD	1.773	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(34)
	19/10/2021	USD	1.289	EUR	1.089	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	26
	19/10/2021	EUR	493	USD	582	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
	19/10/2021	EUR	3.159	USD	3.710	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(47)
	19/10/2021	USD	44.547	EUR	37.957	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	540
	19/10/2021	USD	69.070	EUR	58.852	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	837
	19/10/2021	USD	30.100	EUR	25.648	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	365
	19/10/2021	USD	6.135	EUR	5.229	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	72
	19/10/2021	USD	18.605	EUR	15.861	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	216
	19/10/2021	EUR	16.401	USD	19.239	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(224)
	19/10/2021	EUR	22.754	USD	26.715	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(334)
	19/10/2021	EUR	35.850	USD	42.091	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(527)
	19/10/2021	EUR	16.200	USD	19.020	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(238)
	19/10/2021	USD	59.257	EUR	50.569	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	628
	19/10/2021	USD	32.617	EUR	27.925	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	240
	19/10/2021	USD	53.773	EUR	46.039	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	396
	19/10/2021	USD	24.061	EUR	20.600	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	177
								<b>(68.688) USD</b>



## Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
<b>Threadneedle (Lux) - Global Equity Income</b>	19/10/2021	SGD	5.374.283	USD	4.001.849	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(43.341)
	19/10/2021	SGD	803.198	USD	598.085	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6.477)
	19/10/2021	SGD	594.372	USD	442.587	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.793)
	19/10/2021	AUD	85.368	USD	62.618	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(948)
	19/10/2021	EUR	54.139	USD	64.006	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.238)
	19/10/2021	EUR	852	USD	1.007	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(19)
	19/10/2021	USD	500	SGD	671	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/10/2021	USD	77.926	SGD	104.573	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	901
	19/10/2021	SGD	2.000	USD	1.490	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17)
	19/10/2021	SGD	100	USD	75	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2021	USD	111.686	SGD	150.934	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	513
	19/10/2021	USD	17.019	SGD	23.000	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	78
	19/10/2021	USD	12.565	SGD	16.980	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	58
	19/10/2021	USD	1.781	AUD	2.449	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12
	19/10/2021	USD	1.820	EUR	1.551	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	22
	19/10/2021	USD	29	EUR	25	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	118.065	SGD	159.720	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	421
	19/10/2021	SGD	99	USD	73	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	SGD	7.603	USD	5.615	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(15)
	19/10/2021	SGD	121	USD	89	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
19/10/2021	USD	692	SGD	940	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0	
19/10/2021	SGD	138	USD	101	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0	
19/10/2021	SGD	67	USD	49	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0	
								<b>(54.838) USD</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies</b>	19/10/2021	CHF	1.027	EUR	943	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
	19/10/2021	GBP	3.363.852	EUR	3.942.690	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(30.462)
	19/10/2021	CHF	21.290.500	EUR	19.555.498	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	139.566
	19/10/2021	GBP	812	EUR	951	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
	19/10/2021	EUR	38.607	GBP	32.941	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	296
	19/10/2021	EUR	4.394	GBP	3.752	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	30
	19/10/2021	GBP	3.375	EUR	3.947	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(22)
	19/10/2021	GBP	2.300	EUR	2.691	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(16)
	19/10/2021	EUR	8.805	CHF	9.583	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(60)
	19/10/2021	EUR	9.681	GBP	8.270	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	63
	19/10/2021	GBP	2.406	EUR	2.803	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
	19/10/2021	EUR	26.086	CHF	28.384	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(171)
	19/10/2021	GBP	3.360	EUR	3.908	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	CHF	57.089	EUR	52.768	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	42
	19/10/2021	EUR	1.961	GBP	1.687	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2021	EUR	973	GBP	832	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
	19/10/2021	GBP	500	EUR	583	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/10/2021	EUR	6.780	CHF	7.344	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14)
19/10/2021	GBP	15.940	EUR	18.664	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(126)	
19/10/2021	EUR	24	CHF	26	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0	

## Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
<b>Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies</b> (continuación)								
	19/10/2021	EUR	99.506	GBP	85.891	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(387)
	19/10/2021	EUR	501.312	CHF	544.420	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.311)
	19/10/2021	EUR	24	GBP	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	GBP	2.631	EUR	3.049	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
	19/10/2021	CHF	18.586	EUR	17.146	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	47
	19/10/2021	GBP	58.458	EUR	67.548	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	439
								<b>106.920 EUR</b>
<b>Threadneedle (Lux) - American</b>								
	19/10/2021	EUR	85.774.291	USD	101.407.256	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.962.086)
	19/10/2021	EUR	2.692.313	USD	3.183.006	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(61.587)
	19/10/2021	EUR	28.554.267	USD	33.758.482	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(653.179)
	19/10/2021	EUR	21.286.512	USD	25.166.128	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(486.929)
	19/10/2021	EUR	2.924.005	USD	3.456.925	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(66.887)
	19/10/2021	EUR	720.725	USD	852.083	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(16.487)
	19/10/2021	EUR	875	USD	1.035	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20)
	19/10/2021	EUR	177.224	USD	209.440	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.969)
	19/10/2021	EUR	3.259	USD	3.852	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(73)
	19/10/2021	USD	23.331	EUR	19.743	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	442
	19/10/2021	EUR	18.231	USD	21.545	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(408)
	19/10/2021	USD	24.875	EUR	21.029	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	494
	19/10/2021	EUR	1.913	USD	2.263	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(45)
	19/10/2021	USD	2.836	EUR	2.397	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	56
	19/10/2021	EUR	458.246	USD	541.920	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10.637)
	19/10/2021	USD	1.745	EUR	1.476	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	34
	19/10/2021	EUR	23.724	USD	28.056	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(551)
	19/10/2021	USD	12.485	EUR	10.558	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	245
	19/10/2021	USD	65.447	EUR	55.604	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	980
	19/10/2021	USD	3.983	EUR	3.384	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	60
	19/10/2021	EUR	224	USD	264	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
	19/10/2021	EUR	80.231	USD	94.218	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.199)
	19/10/2021	USD	29.296	EUR	24.947	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	373
	19/10/2021	EUR	9.672	USD	11.358	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(145)
	19/10/2021	USD	2.754.460	EUR	2.346.995	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	33.384
	19/10/2021	USD	85.549	EUR	72.894	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.037
	19/10/2021	USD	904.989	EUR	771.115	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10.968
	19/10/2021	USD	675.040	EUR	575.182	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8.181
	19/10/2021	USD	93.402	EUR	79.585	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.132
	19/10/2021	USD	22.834	EUR	19.456	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	277
	19/10/2021	USD	28	EUR	24	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	235.901	USD	276.738	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.239)
	19/10/2021	EUR	503	USD	590	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
	19/10/2021	EUR	7.434	USD	8.721	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(102)
	19/10/2021	EUR	147.431	USD	172.940	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.012)
	19/10/2021	EUR	9.970	USD	11.695	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(136)
	19/10/2021	EUR	365.280	USD	428.483	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.984)
	19/10/2021	EUR	171.322	USD	201.107	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.480)

## Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
<b>Threadneedle (Lux) - American</b>								
<i>(continuación)</i>	19/10/2021	USD	9.200	EUR	7.838	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	113
	19/10/2021	USD	51.778	EUR	44.110	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	638
	19/10/2021	EUR	148.213	USD	174.214	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.379)
	19/10/2021	EUR	3.580	USD	4.208	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(57)
	19/10/2021	EUR	23.072	USD	27.119	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(370)
	19/10/2021	EUR	151.566	USD	177.606	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.883)
	19/10/2021	EUR	830	USD	973	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10)
	19/10/2021	USD	2.188	EUR	1.868	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	23
	19/10/2021	EUR	133.574	USD	156.345	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.482)
	19/10/2021	EUR	647	USD	757	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
	19/10/2021	EUR	5.701	USD	6.673	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(63)
	19/10/2021	EUR	100	USD	117	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2021	EUR	134.890	USD	157.517	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.128)
	19/10/2021	EUR	98	USD	114	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2021	EUR	2.197	USD	2.566	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(18)
	19/10/2021	USD	4.907	EUR	4.202	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	35
	19/10/2021	USD	8.333	EUR	7.172	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	18
	19/10/2021	USD	30.796	EUR	26.505	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	66
	19/10/2021	EUR	11.556	USD	13.427	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(29)
	19/10/2021	USD	2.353	EUR	2.025	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
								<b>(3.226.033) USD</b>
<b>Threadneedle (Lux) - American Select</b>								
	19/10/2021	EUR	802.186	USD	948.390	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(18.350)
	19/10/2021	EUR	508.795	USD	601.526	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11.639)
	19/10/2021	EUR	733.015	USD	866.612	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(16.768)
	19/10/2021	EUR	874	USD	1.033	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20)
	19/10/2021	EUR	371.829	USD	439.598	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8.506)
	19/10/2021	EUR	12.140	USD	14.353	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(278)
	19/10/2021	EUR	262.258	USD	310.057	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5.999)
	19/10/2021	USD	318	EUR	269	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/10/2021	EUR	46	USD	54	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2021	USD	30.246	EUR	25.772	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	367
	19/10/2021	USD	19.267	EUR	16.417	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	234
	19/10/2021	USD	27.497	EUR	23.430	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	333
	19/10/2021	USD	33	EUR	28	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	14.008	EUR	11.936	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	170
	19/10/2021	USD	456	EUR	388	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/10/2021	USD	9.847	EUR	8.391	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	119
	19/10/2021	USD	1.927	EUR	1.642	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	24
	19/10/2021	EUR	33	USD	39	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	34	USD	39	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2021	USD	281.023	EUR	239.081	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.835
	19/10/2021	EUR	4.463	USD	5.242	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(67)
	19/10/2021	EUR	34	USD	39	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	250	USD	292	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
								<b>(56.537) USD</b>

## Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
<b>Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies</b>								
	19/10/2021	EUR	9.742	USD	11.438	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(143)
	19/10/2021	EUR	7.168	USD	8.426	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(115)
	19/10/2021	EUR	19.975	USD	23.407	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(248)
	19/10/2021	EUR	5.085	USD	5.908	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13)
	19/10/2021	EUR	1.779.909	USD	2.104.310	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(40.716)
	19/10/2021	EUR	350.095	USD	413.902	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8.008)
	19/10/2021	EUR	5.624.890	USD	6.650.065	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(128.670)
	19/10/2021	EUR	319.233	USD	377.416	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7.302)
	19/10/2021	EUR	9.562	USD	11.311	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(225)
	19/10/2021	USD	9.391	EUR	7.941	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	184
	19/10/2021	EUR	102	USD	120	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/10/2021	USD	43.535	EUR	37.095	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	528
	19/10/2021	USD	8.579	EUR	7.310	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	104
	19/10/2021	USD	135.896	EUR	115.793	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.647
	19/10/2021	USD	7.722	EUR	6.580	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	94
	19/10/2021	USD	4.786	EUR	4.080	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	56
	19/10/2021	EUR	54.329	USD	63.787	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(799)
	19/10/2021	EUR	10.640	USD	12.492	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(156)
	19/10/2021	EUR	171.389	USD	201.225	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.520)
								<b>(186.304) USD</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity</b>								
	19/10/2021	SGD	862.978	USD	642.599	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6.960)
	19/10/2021	SGD	1.251	USD	932	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10)
	19/10/2021	EUR	795	USD	940	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(18)
	19/10/2021	SGD	1.625	USD	1.211	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14)
	19/10/2021	SGD	250	USD	186	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/10/2021	USD	18.722	SGD	25.196	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	163
	19/10/2021	USD	27	SGD	36	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	27	EUR	23	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	4.357	SGD	5.864	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	37
	19/10/2021	USD	16.227	SGD	21.929	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	75
	19/10/2021	USD	24	SGD	32	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	24	EUR	20	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	SGD	23.935	USD	17.718	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(88)
	19/10/2021	SGD	35	USD	26	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	22	USD	26	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	153.442	SGD	207.776	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	401
	19/10/2021	USD	11.080	SGD	15.036	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/10/2021	USD	20	SGD	27	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	20	EUR	18	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
								<b>(6.410) USD</b>

## Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
<b>Threadneedle (Lux) - Asia Equities</b>								
	19/10/2021	EUR	785	USD	928	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(18)
	19/10/2021	EUR	784	USD	927	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17)
	19/10/2021	USD	21	EUR	18	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	21	EUR	18	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	24	EUR	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	24	EUR	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	18	USD	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	18	USD	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	19	EUR	16	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	19	EUR	16	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
								<b>(35) USD</b>
<b>Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities</b>								
	19/10/2021	EUR	(1.406.016)	USD	1.406.016	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(27.204)
	19/10/2021	EUR	(11.003.940)	USD	11.003.940	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(212.911)
	19/10/2021	CHF	(1.041)	USD	1.041	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13)
	19/10/2021	GBP	(1.029)	USD	1.029	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(28)
	19/10/2021	EUR	(7.704)	USD	7.704	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(149)
	19/10/2021	SGD	(109.624.970)	USD	109.624.970	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.187.242)
	19/10/2021	USD	(47.065)	EUR	47.065	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.054
	19/10/2021	EUR	(1.673)	USD	1.673	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(32)
	19/10/2021	EUR	(1.377)	USD	1.377	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(27)
	19/10/2021	USD	(2.343)	EUR	2.343	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	54
	19/10/2021	USD	(5.389)	EUR	5.389	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	95
	19/10/2021	USD	(11.038)	EUR	11.038	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	165
	19/10/2021	EUR	(575)	USD	575	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
	19/10/2021	USD	(30.834)	EUR	30.834	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	439
	19/10/2021	USD	(251.253)	EUR	251.253	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.574
	19/10/2021	USD	(26)	CHF	26	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	(20)	GBP	20	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	(177)	EUR	177	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	19/10/2021	USD	(3.941.776)	SGD	3.941.776	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13.400
	19/10/2021	USD	(1.787)	EUR	1.787	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	25
	19/10/2021	EUR	(733)	USD	733	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
	19/10/2021	USD	(13.950)	EUR	13.950	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	202
	19/10/2021	EUR	(28.317)	USD	28.317	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(355)
	19/10/2021	EUR	(233.361)	USD	233.361	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.922)
	19/10/2021	CHF	(22)	USD	22	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	GBP	(22)	USD	22	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	(163)	USD	163	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/10/2021	SGD	(2.341.553)	USD	2.341.553	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11.680)
	19/10/2021	USD	(12.910)	EUR	12.910	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	207
	19/10/2021	EUR	(554)	USD	554	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
	19/10/2021	EUR	(10.127)	USD	10.127	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(96)
	19/10/2021	USD	(22.487)	EUR	22.487	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	194
	19/10/2021	USD	(183.675)	EUR	183.675	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.582
	19/10/2021	USD	(19)	CHF	19	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	(15)	GBP	15	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0

## Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
<b>Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities</b>								
(continuación)	19/10/2021	USD	(168)	EUR	168	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2021	USD	(2.872.056)	SGD	2.872.056	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.065
	19/10/2021	EUR	(117)	USD	117	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2021	EUR	(4.186)	USD	4.186	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(30)
	19/10/2021	EUR	(3.305)	USD	3.305	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
								<b>(1.420.661) USD</b>
<b>Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities</b>								
	19/10/2021	EUR	888	USD	1.050	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20)
	19/10/2021	EUR	3.237	USD	3.827	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(74)
	19/10/2021	EUR	1.185.514	USD	1.401.583	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(27.118)
	19/10/2021	CHF	974	USD	1.058	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13)
	19/10/2021	EUR	898	USD	1.062	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(21)
	19/10/2021	CHF	985	USD	1.070	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13)
	19/10/2021	EUR	895	USD	1.058	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20)
	19/10/2021	EUR	2.939	USD	3.474	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(66)
	19/10/2021	EUR	2.150	USD	2.543	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(51)
	19/10/2021	USD	31	EUR	26	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2021	EUR	3.836	USD	4.515	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(68)
	19/10/2021	EUR	370	USD	434	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
	19/10/2021	USD	26	EUR	22	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	95	EUR	81	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2021	USD	34.884	EUR	29.724	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	423
	19/10/2021	USD	26	CHF	24	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	26	EUR	22	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	26	CHF	24	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	26	EUR	22	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	467	EUR	398	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
	19/10/2021	EUR	3.150	USD	3.695	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(43)
	19/10/2021	EUR	988	USD	1.159	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14)
	19/10/2021	CHF	19	USD	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	18	USD	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	CHF	20	USD	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	130	EUR	111	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	19/10/2021	EUR	18	USD	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	66	USD	77	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2021	EUR	24.406	USD	28.588	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(292)
	19/10/2021	EUR	358	USD	419	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
	19/10/2021	USD	24	EUR	20	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	86	EUR	74	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2021	USD	31.873	EUR	27.288	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	235
	19/10/2021	USD	23	CHF	22	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	23	EUR	20	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	24	CHF	22	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	688.261	EUR	592.375	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.472
								<b>(25.684) USD</b>

## Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities</b>								
	19/10/2021	SGD	8.664.146	EUR	5.455.750	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	48.654
	19/10/2021	USD	46.314	EUR	39.174	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	773
	19/10/2021	USD	269.579	EUR	228.021	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.500
	19/10/2021	EUR	1.896	SGD	3.006	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14)
	19/10/2021	SGD	2.882	EUR	1.816	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15
	19/10/2021	SGD	28.634	EUR	18.054	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	137
	19/10/2021	SGD	12.391	EUR	7.821	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	51
	19/10/2021	EUR	1.962	SGD	3.106	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12)
	19/10/2021	EUR	187.357	SGD	297.198	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.456)
	19/10/2021	EUR	1.340	USD	1.573	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(16)
	19/10/2021	EUR	7.823	USD	9.182	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(96)
	19/10/2021	EUR	17.927	SGD	28.421	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(129)
	19/10/2021	EUR	23.342	SGD	37.040	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(190)
	19/10/2021	SGD	184.612	EUR	116.675	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	611
	19/10/2021	USD	991	EUR	845	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
	19/10/2021	USD	5.757	EUR	4.912	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	54
	19/10/2021	SGD	12.637	EUR	7.967	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	61
	19/10/2021	USD	5.000	EUR	4.259	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	53
	19/10/2021	SGD	215	EUR	136	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2021	SGD	19.200	EUR	12.101	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	97
	19/10/2021	EUR	528	SGD	837	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
	19/10/2021	EUR	198.765	SGD	315.087	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.413)
	19/10/2021	EUR	1.434	USD	1.675	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
	19/10/2021	EUR	8.526	USD	9.958	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(63)
	19/10/2021	SGD	5.128	EUR	3.235	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	23
	19/10/2021	EUR	27.822	USD	32.489	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(201)
	19/10/2021	SGD	41.677	EUR	26.362	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	116
								<b>51.550 EUR</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities</b>								
	19/10/2021	SGD	41.306.418	EUR	26.010.354	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	231.956
	19/10/2021	CHF	19.476	EUR	17.889	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	128
	19/10/2021	USD	546.772	EUR	462.482	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9.125
	19/10/2021	USD	4.466	EUR	3.778	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	75
	19/10/2021	SGD	14.127	EUR	8.908	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	67
	19/10/2021	CHF	7.580	EUR	6.970	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	42
	19/10/2021	SGD	16.172	EUR	10.188	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	86
	19/10/2021	SGD	74.100	EUR	46.722	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	355
	19/10/2021	EUR	12.219	SGD	19.359	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(80)
	19/10/2021	SGD	5.658	EUR	3.573	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	21
	19/10/2021	EUR	713.282	SGD	1.131.455	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5.543)
	19/10/2021	EUR	678	CHF	738	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
	19/10/2021	EUR	12.690	USD	14.893	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(156)
	19/10/2021	EUR	104	USD	122	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2021	SGD	30.816	EUR	19.438	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	140
	19/10/2021	EUR	18.457	SGD	29.288	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(150)

## Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities</b> (continuación)								
	19/10/2021	EUR	2.678	SGD	4.248	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(21)
	19/10/2021	USD	13.450	EUR	11.458	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	143
	19/10/2021	SGD	940.514	EUR	593.143	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.373
	19/10/2021	CHF	615	EUR	567	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	19/10/2021	USD	12.474	EUR	10.624	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	135
	19/10/2021	SGD	17.292	EUR	10.922	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	63
	19/10/2021	SGD	47.648	EUR	30.029	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	242
	19/10/2021	EUR	686.334	SGD	1.087.136	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.334)
	19/10/2021	EUR	655	CHF	711	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/10/2021	EUR	12.286	USD	14.354	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(95)
	19/10/2021	SGD	23.302	EUR	14.705	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	99
	19/10/2021	EUR	818.938	SGD	1.298.200	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5.822)
	19/10/2021	EUR	782	CHF	849	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
	19/10/2021	EUR	14.606	USD	17.060	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(109)
	19/10/2021	EUR	658	USD	769	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
	19/10/2021	SGD	8.883	EUR	5.603	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	40
	19/10/2021	SGD	103.354	EUR	65.375	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	287
								<b>231.052 EUR</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies</b>								
	19/10/2021	EUR	8.552	CHF	9.307	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(57)
	19/10/2021	EUR	83.297	USD	97.758	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.023)
	19/10/2021	USD	16.500	EUR	14.065	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	167
	19/10/2021	USD	99.808	EUR	85.086	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.001
	19/10/2021	USD	160.000	EUR	136.303	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.702
	19/10/2021	EUR	9.240	CHF	10.004	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(15)
	19/10/2021	CHF	95.740	EUR	88.224	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	341
	19/10/2021	USD	926.081	EUR	788.770	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10.001
	19/10/2021	CHF	317.391	EUR	292.477	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.130
	19/10/2021	USD	500.761	EUR	426.513	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5.408
	19/10/2021	CHF	7.325	EUR	6.750	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	26
	19/10/2021	EUR	103.109	CHF	111.863	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(371)
	19/10/2021	EUR	920.700	USD	1.075.679	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7.106)
	19/10/2021	EUR	339.994	CHF	368.858	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.223)
	19/10/2021	EUR	492.631	USD	575.555	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.802)
	19/10/2021	EUR	7.840	CHF	8.506	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(28)
	19/10/2021	EUR	93.563	USD	109.313	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(722)
	19/10/2021	EUR	544.206	USD	635.631	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.045)
	19/10/2021	EUR	8.569	CHF	9.306	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(40)
	19/10/2021	EUR	102.079	USD	119.228	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(759)
	19/10/2021	EUR	188.236	USD	219.812	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.358)
	19/10/2021	EUR	22.368	CHF	24.247	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(62)
	19/10/2021	EUR	4.391	CHF	4.760	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12)
	19/10/2021	CHF	4.082.862	EUR	3.750.142	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	26.764
	19/10/2021	USD	39.007.536	EUR	32.994.126	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	650.985
	19/10/2021	CHF	13.629.811	EUR	12.519.092	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	89.347



## Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies</b> (continuación)								
	19/10/2021	USD	21.209.524	EUR	17.939.859	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	353.960
	19/10/2021	CHF	448.943	EUR	412.358	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.943
	19/10/2021	USD	4.025.798	EUR	3.405.180	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	67.185
	19/10/2021	CHF	10.222	EUR	9.406	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	50
	19/10/2021	USD	102.372	EUR	86.566	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.733
	19/10/2021	EUR	109.295	CHF	118.715	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(524)
	19/10/2021	EUR	13.335	USD	15.770	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(267)
	19/10/2021	EUR	124.359	CHF	135.077	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(596)
	19/10/2021	USD	50.000	EUR	42.480	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	646
	19/10/2021	CHF	23.767	EUR	21.837	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	149
	19/10/2021	EUR	92.693	CHF	100.874	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(622)
	19/10/2021	EUR	814.268	USD	955.634	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9.997)
	19/10/2021	EUR	305.753	CHF	332.740	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.053)
	19/10/2021	EUR	438.808	USD	514.990	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5.388)
	19/10/2021	USD	95.135	EUR	81.030	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.027
	19/10/2021	USD	50.000	EUR	42.538	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	589
	19/10/2021	CHF	13.448	EUR	12.411	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	30
	19/10/2021	EUR	19.040	CHF	20.626	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(40)
	19/10/2021	USD	5.000	EUR	4.272	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	41
	19/10/2021	EUR	8.252	CHF	8.939	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17)
	19/10/2021	USD	260.000	EUR	222.131	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.126
	19/10/2021	EUR	111.813	CHF	121.428	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(515)
	19/10/2021	EUR	1.001.921	USD	1.170.241	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7.449)
	19/10/2021	EUR	371.316	CHF	403.246	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.712)
								<b>1.167.548 EUR</b>
<b>Threadneedle (Lux) - European Select</b>								
	19/10/2021	USD	485.764	EUR	410.879	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8.107
	19/10/2021	USD	1.064	EUR	900	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	18
	19/10/2021	GBP	6.699	EUR	7.851	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(61)
	19/10/2021	GBP	10.206.287	EUR	11.962.545	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(92.428)
	19/10/2021	SGD	49.599.371	EUR	31.232.366	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	278.525
	19/10/2021	USD	7.206.727	EUR	6.095.736	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	120.271
	19/10/2021	SGD	992	EUR	625	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
	19/10/2021	EUR	175	USD	207	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
	19/10/2021	EUR	25.988	GBP	22.191	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	180
	19/10/2021	SGD	4.959	EUR	3.124	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	26
	19/10/2021	SGD	2.975	EUR	1.876	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	14
	19/10/2021	EUR	20.966	USD	24.795	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(420)
	19/10/2021	GBP	16.514	EUR	19.333	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(126)
	19/10/2021	SGD	875	EUR	553	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	19/10/2021	EUR	85	GBP	73	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	1.984	EUR	1.691	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	20
	19/10/2021	SGD	99	EUR	63	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	16.345	GBP	14.005	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	57

## Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
<b>Threadneedle (Lux) - European Select</b>								
<i>(continuación)</i>	19/10/2021	EUR	1.479	SGD	2.346	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12)
	19/10/2021	EUR	8.474	USD	9.901	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(65)
	19/10/2021	EUR	19	USD	22	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	161	GBP	137	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2021	EUR	241.437	GBP	206.062	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.783
	19/10/2021	EUR	638.935	SGD	1.012.056	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.035)
	19/10/2021	EUR	125.025	USD	146.070	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(965)
	19/10/2021	GBP	1.995	EUR	2.336	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(16)
	19/10/2021	SGD	1.254.159	EUR	791.436	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5.342
	19/10/2021	USD	26	EUR	22	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	10.860	USD	12.684	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(81)
	19/10/2021	EUR	24	USD	28	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	206	GBP	177	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2021	EUR	312.505	GBP	269.747	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.216)
	19/10/2021	EUR	840.604	SGD	1.332.544	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5.975)
	19/10/2021	EUR	160.587	USD	187.565	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.194)
	19/10/2021	EUR	27.264	GBP	23.522	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(92)
	19/10/2021	EUR	3.002	GBP	2.598	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20)
	19/10/2021	SGD	992	EUR	627	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
								<b>307.645 EUR</b>
<b>Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies</b>								
	19/10/2021	CHF	479.769	EUR	440.672	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.145
	19/10/2021	CHF	12.050.950	EUR	11.068.895	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	78.996
	19/10/2021	CHF	1.814	EUR	1.666	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12
	19/10/2021	EUR	11.466	CHF	12.478	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(77)
	19/10/2021	EUR	286.359	CHF	311.635	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.923)
	19/10/2021	EUR	43	CHF	47	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	34.610	CHF	37.443	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(28)
	19/10/2021	CHF	10.389	EUR	9.574	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	37
	19/10/2021	CHF	261.360	EUR	240.844	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	931
	19/10/2021	CHF	39	EUR	36	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	12.620	CHF	13.691	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(45)
	19/10/2021	EUR	315.108	CHF	341.859	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.133)
	19/10/2021	EUR	48	CHF	52	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	13.109	CHF	14.236	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(60)
	19/10/2021	EUR	328.107	CHF	356.321	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.513)
	19/10/2021	EUR	50	CHF	54	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
								<b>78.342 EUR</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income</b>								
	19/10/2021	EUR	2.097.222	USD	2.479.455	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(47.974)
	19/10/2021	EUR	963.263	USD	1.138.824	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(22.035)
	19/10/2021	GBP	190.088	USD	263.404	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7.093)
	19/10/2021	EUR	48	USD	57	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2021	USD	65.765	EUR	55.839	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.025
	19/10/2021	USD	30.138	EUR	25.589	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	470

## Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
<b>Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income</b> <i>(continuación)</i>								
	19/10/2021	USD	6.945	GBP	5.033	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	158
	19/10/2021	EUR	3.159	USD	3.710	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(47)
	19/10/2021	USD	93.131	EUR	79.354	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.128
	19/10/2021	USD	42.648	EUR	36.339	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	517
	19/10/2021	USD	9.795	GBP	7.166	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	133
	19/10/2021	EUR	96	USD	113	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2021	USD	543	EUR	462	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
	19/10/2021	EUR	55.846	USD	65.568	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(821)
	19/10/2021	EUR	25.669	USD	30.138	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(377)
	19/10/2021	GBP	5.058	USD	6.940	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(120)
	19/10/2021	USD	549	EUR	467	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
	19/10/2021	USD	48.056	EUR	41.144	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	354
	19/10/2021	USD	21.914	EUR	18.762	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	162
	19/10/2021	USD	5.016	GBP	3.706	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19
	19/10/2021	EUR	150	USD	175	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2021	USD	10.516	EUR	9.051	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	23
	19/10/2021	EUR	12.930	USD	15.023	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(32)
								<b>(74.499) USD</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Global Technology</b>								
	19/10/2021	EUR	1.135.649	USD	1.342.629	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(25.977)
	19/10/2021	EUR	40.086.668	USD	47.392.744	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(916.982)
	19/10/2021	EUR	81.841.725	USD	96.757.952	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.872.128)
	19/10/2021	EUR	1.318.743	USD	1.559.093	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(30.166)
	19/10/2021	CHF	2.306.029	USD	2.504.756	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(31.536)
	19/10/2021	EUR	29.990	USD	35.442	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(672)
	19/10/2021	USD	52.322	EUR	44.274	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	991
	19/10/2021	USD	271.850	EUR	230.034	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5.150
	19/10/2021	EUR	24.990	USD	29.561	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(588)
	19/10/2021	EUR	567	USD	671	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13)
	19/10/2021	USD	8.113	EUR	6.859	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	161
	19/10/2021	EUR	8.337	USD	9.859	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(194)
	19/10/2021	EUR	173	USD	204	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
	19/10/2021	EUR	50.439	USD	59.368	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(889)
	19/10/2021	EUR	21.346	USD	25.067	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(319)
	19/10/2021	EUR	26.883	USD	31.569	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(402)
	19/10/2021	USD	36.832	EUR	31.383	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	446
	19/10/2021	USD	1.226.370	EUR	1.044.955	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	14.863
	19/10/2021	USD	2.477.061	EUR	2.110.632	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	30.021
	19/10/2021	USD	40.058	EUR	34.132	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	485
	19/10/2021	USD	64.238	CHF	59.555	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	365
	19/10/2021	EUR	199	USD	233	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
	19/10/2021	EUR	86.273	USD	101.208	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.185)
	19/10/2021	EUR	113.161	USD	132.751	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.554)
	19/10/2021	EUR	15.458	USD	18.132	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(211)
	19/10/2021	USD	25.511	EUR	21.732	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	314
	19/10/2021	EUR	17.537	USD	20.585	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(254)
	19/10/2021	EUR	31.864	USD	37.411	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(468)

## Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
<b>Threadneedle (Lux) - Global Technology</b> (continuación)								
	19/10/2021	EUR	1.069.918	USD	1.256.172	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(15.728)
	19/10/2021	EUR	2.178.911	USD	2.558.220	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(32.030)
	19/10/2021	EUR	35.150	USD	41.269	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(517)
	19/10/2021	CHF	61.567	USD	66.593	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(563)
	19/10/2021	EUR	34.755	USD	40.852	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(558)
	19/10/2021	EUR	49.975	USD	58.561	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(621)
	19/10/2021	USD	43.078	EUR	36.762	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	456
	19/10/2021	USD	13.554	EUR	11.579	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	128
	19/10/2021	USD	18.613	EUR	15.902	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	176
	19/10/2021	USD	45.811	EUR	39.222	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	338
	19/10/2021	USD	1.479.209	EUR	1.266.449	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10.908
	19/10/2021	USD	2.993.076	EUR	2.562.571	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	22.070
	19/10/2021	USD	48.328	EUR	41.377	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	356
	19/10/2021	USD	77.821	CHF	72.342	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	234
	19/10/2021	EUR	15.629	USD	18.251	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(131)
	19/10/2021	EUR	91.412	USD	106.746	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(764)
	19/10/2021	EUR	99.750	USD	116.482	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(834)
	19/10/2021	EUR	11.889	USD	13.813	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(30)
	19/10/2021	EUR	54.346	USD	63.142	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(135)
	19/10/2021	USD	1.270	EUR	1.093	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
								<b>(2.847.990) USD</b>
<b>Threadneedle (Lux) - UK Equities</b>								
	19/10/2021	CHF	117.429	GBP	92.046	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.357
	19/10/2021	EUR	8.597.453	GBP	7.335.235	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	57.116
	19/10/2021	EUR	7.627.526	GBP	6.507.706	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	50.672
	19/10/2021	USD	997.540	GBP	719.884	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19.919
	19/10/2021	EUR	3.249.641	GBP	2.772.552	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	21.589
	19/10/2021	CHF	32.438	GBP	25.426	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	375
	19/10/2021	EUR	639.225	GBP	545.378	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.247
	19/10/2021	EUR	4.161.772	GBP	3.550.770	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	27.648
	19/10/2021	CHF	84.316	GBP	66.091	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	974
	19/10/2021	USD	4.420.993	GBP	3.190.449	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	88.285
	19/10/2021	EUR	93.864	GBP	80.083	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	624
	19/10/2021	CHF	67.380	GBP	52.815	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	778
	19/10/2021	USD	333.072	GBP	240.365	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6.651
	19/10/2021	EUR	859	GBP	733	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/10/2021	CHF	949	GBP	744	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	11
	19/10/2021	USD	1.025	GBP	740	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	20
	19/10/2021	EUR	859	GBP	733	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/10/2021	CHF	949	GBP	744	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	11
	19/10/2021	USD	1.025	GBP	740	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	20
	19/10/2021	GBP	142.356	EUR	166.839	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.098)
	19/10/2021	EUR	13.835	GBP	11.804	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	91
	19/10/2021	EUR	4.149	GBP	3.540	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	27
	19/10/2021	GBP	106.011	EUR	124.243	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(817)
	19/10/2021	EUR	5.300	GBP	4.526	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	32

## Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
<b>Threadneedle (Lux) - UK Equities</b> (continuación)								
	19/10/2021	EUR	22.917	GBP	19.569	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	136
	19/10/2021	EUR	1.106	GBP	945	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
	19/10/2021	EUR	8.131	GBP	6.943	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	48
	19/10/2021	EUR	5.200	GBP	4.446	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	25
	19/10/2021	GBP	188.419	EUR	220.348	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.043)
	19/10/2021	EUR	7.857	GBP	6.716	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	40
	19/10/2021	GBP	7.558	EUR	8.842	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(45)
	19/10/2021	EUR	9.459	GBP	8.085	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	48
	19/10/2021	GBP	4.821	EUR	5.644	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(32)
	19/10/2021	GBP	48.921	EUR	57.270	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(322)
	19/10/2021	GBP	2.754	CHF	3.491	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(23)
	19/10/2021	GBP	213.834	EUR	249.136	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(381)
	19/10/2021	GBP	192.651	EUR	224.456	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(344)
	19/10/2021	GBP	21.440	USD	29.306	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(294)
	19/10/2021	GBP	81.820	EUR	95.328	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(146)
	19/10/2021	GBP	757	CHF	960	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
	19/10/2021	GBP	16.379	EUR	19.084	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(29)
	19/10/2021	GBP	102.667	EUR	119.617	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(183)
	19/10/2021	GBP	1.966	CHF	2.492	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(16)
	19/10/2021	GBP	94.913	USD	129.734	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.302)
	19/10/2021	GBP	2.378	EUR	2.771	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
	19/10/2021	GBP	1.571	CHF	1.991	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13)
	19/10/2021	GBP	7.149	USD	9.772	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(98)
	19/10/2021	GBP	22	EUR	25	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	GBP	22	CHF	28	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	GBP	22	USD	30	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	GBP	22	EUR	25	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	GBP	22	CHF	28	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	GBP	22	USD	30	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	10.800	GBP	9.267	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19
	19/10/2021	EUR	3.890	GBP	3.344	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	16.890	GBP	14.522	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2021	EUR	1.864	GBP	1.603	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	CHF	2.664	GBP	2.112	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/10/2021	EUR	192.223	GBP	165.088	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	191
	19/10/2021	EUR	169.051	GBP	145.187	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	168
	19/10/2021	USD	22.766	GBP	16.675	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	209
	19/10/2021	EUR	72.463	GBP	62.234	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	72
	19/10/2021	CHF	737	GBP	585	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	19/10/2021	EUR	14.468	GBP	12.426	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	14
	19/10/2021	EUR	92.192	GBP	79.178	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	92
	19/10/2021	CHF	1.917	GBP	1.520	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
	19/10/2021	USD	100.943	GBP	73.936	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	926
	19/10/2021	EUR	2.134	GBP	1.833	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	19/10/2021	CHF	1.532	GBP	1.215	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
	19/10/2021	USD	7.606	GBP	5.571	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	70
	19/10/2021	EUR	20	GBP	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0

## Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
<b>Threadneedle (Lux) - UK Equities</b> (continuación)								
	19/10/2021	CHF	22	GBP	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	23	GBP	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	20	GBP	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	CHF	22	GBP	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	23	GBP	17	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	GBP	5.832	EUR	6.780	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	19/10/2021	GBP	27.119	EUR	31.525	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
	19/10/2021	CHF	30.518	GBP	24.085	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	189
	19/10/2021	GBP	2.326	EUR	2.720	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13)
	19/10/2021	EUR	14.909	GBP	12.750	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	70
	19/10/2021	GBP	13.785	EUR	16.119	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(75)
	19/10/2021	GBP	16.942	EUR	19.773	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(59)
	19/10/2021	GBP	3.228	EUR	3.767	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
	19/10/2021	GBP	3.883	EUR	4.547	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(26)
	19/10/2021	EUR	92.956	GBP	79.387	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	539
	19/10/2021	EUR	15.190	GBP	12.972	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	88
	19/10/2021	USD	28.000	GBP	20.430	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	336
	19/10/2021	GBP	125.367	EUR	145.239	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	486
	19/10/2021	GBP	10.845	EUR	12.564	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	42
	19/10/2021	GBP	1.021	EUR	1.183	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	19/10/2021	EUR	12.415	GBP	10.711	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(36)
	19/10/2021	GBP	79.820	EUR	92.232	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	516
								<b>278.413 GBP</b>
<b>Threadneedle (Lux) - UK Equity Income</b>								
	19/10/2021	EUR	4.641.359	GBP	3.959.947	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	30.836
	19/10/2021	EUR	30.172	GBP	25.743	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	200
	19/10/2021	EUR	2.659.900	GBP	2.269.393	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17.672
	19/10/2021	CHF	120.721	GBP	94.627	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.395
	19/10/2021	USD	5.653.559	GBP	4.079.942	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	112.899
	19/10/2021	SGD	1.390	GBP	747	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12
	19/10/2021	EUR	657.415	GBP	560.898	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.368
	19/10/2021	EUR	870	GBP	742	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/10/2021	EUR	2.252.891	GBP	1.922.137	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	14.967
	19/10/2021	USD	1.471.006	GBP	1.061.565	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	29.375
	19/10/2021	USD	1.042	GBP	752	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	21
	19/10/2021	EUR	3.784.617	GBP	3.228.986	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	25.143
	19/10/2021	CHF	336.107	GBP	263.456	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.883
	19/10/2021	USD	876.856	GBP	632.791	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17.510
	19/10/2021	CHF	476.442	GBP	373.457	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5.504
	19/10/2021	CHF	958	GBP	751	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	11
	19/10/2021	USD	3.721.598	GBP	2.685.725	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	74.318
	19/10/2021	EUR	2.043.718	GBP	1.743.674	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13.577
	19/10/2021	USD	27.392	GBP	19.768	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	547
	19/10/2021	EUR	502.562	GBP	428.779	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.339
	19/10/2021	GBP	189.565	EUR	222.169	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.462)
	19/10/2021	EUR	3.988	GBP	3.403	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	26

## Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
<b>Threadneedle (Lux) - UK Equity Income</b> (continuación)								
	19/10/2021	EUR	7.274	GBP	6.207	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	48
	19/10/2021	EUR	1.573	GBP	1.342	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
	19/10/2021	EUR	2.530	GBP	2.160	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15
	19/10/2021	GBP	63.321	EUR	74.156	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(441)
	19/10/2021	GBP	3.427	EUR	4.007	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(19)
	19/10/2021	GBP	3.434	EUR	4.020	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(23)
	19/10/2021	USD	341	GBP	248	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
	19/10/2021	USD	500.000	GBP	365.745	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5.069
	19/10/2021	EUR	10.000	GBP	8.581	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17
	19/10/2021	USD	175.979	GBP	128.727	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.784
	19/10/2021	GBP	5.489	EUR	6.385	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	22.645	GBP	19.470	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2021	USD	184	GBP	135	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	19/10/2021	EUR	1.258	GBP	1.082	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2021	GBP	102.061	EUR	118.643	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	48
	19/10/2021	GBP	10	EUR	11	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	19.313	GBP	16.516	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	90
	19/10/2021	GBP	110.824	EUR	129.594	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(605)
	19/10/2021	EUR	1	GBP	1	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	GBP	28.263	EUR	33.094	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(192)
	19/10/2021	GBP	2.554	USD	3.500	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(42)
	19/10/2021	GBP	96.942	USD	131.204	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(363)
	19/10/2021	GBP	17	SGD	32	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	GBP	13.018	EUR	15.082	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	50
	19/10/2021	GBP	18	EUR	20	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	GBP	24.990	EUR	28.966	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	84
	19/10/2021	EUR	16.000	GBP	13.847	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(89)
	19/10/2021	GBP	1	EUR	1	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	GBP	2.916	EUR	3.370	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19
	19/10/2021	USD	60.008	GBP	44.698	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(194)
	19/10/2021	GBP	4.926	EUR	5.691	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	32
	19/10/2021	EUR	30.687	GBP	26.557	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(172)
								<b>359.280 GBP</b>
<b>Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha</b>								
	19/10/2021	EUR	671.893	USD	794.351	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(15.370)
	19/10/2021	CHF	9.986	USD	10.847	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(137)
	19/10/2021	GBP	20.811	USD	28.838	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(777)
	19/10/2021	EUR	102.307	USD	120.954	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.340)
	19/10/2021	EUR	854.460	USD	1.010.191	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(19.546)
	19/10/2021	GBP	1.941.132	USD	2.689.818	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(72.428)
	19/10/2021	GBP	10.874.143	USD	15.068.257	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(405.735)
	19/10/2021	GBP	40.711	USD	56.413	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.519)
	19/10/2021	EUR	846	USD	1.001	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(19)
	19/10/2021	EUR	500	USD	591	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12)
	19/10/2021	USD	5.872	EUR	5.001	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	75

## Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
<b>Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha</b>								
(continuación)	19/10/2021	CHF	10.048	USD	10.894	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(117)
	19/10/2021	USD	573	EUR	487	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	19/10/2021	USD	9.642	CHF	8.913	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	83
								<b>(517.834) USD</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities</b>								
	19/10/2021	USD	2.724.237	EUR	2.304.268	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	45.464
	19/10/2021	GBP	453.450	EUR	531.477	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.106)
	19/10/2021	GBP	10.777.431	EUR	12.631.969	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(97.600)
	19/10/2021	GBP	2.587.164	EUR	3.032.353	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(23.429)
	19/10/2021	GBP	1.354.138	EUR	1.587.153	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12.263)
	19/10/2021	GBP	728	EUR	853	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
	19/10/2021	GBP	113.169	EUR	132.643	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.025)
	19/10/2021	GBP	164	EUR	192	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2021	EUR	3	GBP	2	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	10.088	GBP	8.614	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	70
	19/10/2021	EUR	60	GBP	51	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	GBP	460	EUR	538	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
	19/10/2021	EUR	37.938	USD	44.654	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(577)
	19/10/2021	EUR	1.857	GBP	1.587	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	11
	19/10/2021	EUR	3.185	GBP	2.721	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	21
	19/10/2021	EUR	102	GBP	88	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	GBP	14	EUR	16	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	62	GBP	54	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	1.954	GBP	1.680	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	43	GBP	37	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	3.338	GBP	2.872	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/10/2021	EUR	720	GBP	616	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
	19/10/2021	EUR	2	GBP	2	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	GBP	17.971	EUR	20.973	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(73)
	19/10/2021	EUR	41	GBP	35	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	14.615	GBP	12.482	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	99
	19/10/2021	EUR	14.645	GBP	12.634	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(49)
	19/10/2021	EUR	54.342	GBP	46.882	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(183)
	19/10/2021	GBP	7.819	EUR	9.035	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	59
	27/10/2021	EUR	244.713.334	GBP	209.340.878	Operaciones comerciales	Barclays	1.280.663
	27/10/2021	EUR	150.622.881	USD	176.769.597	Operaciones comerciales	Barclays	(1.823.487)
								<b>(636.414) EUR</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities</b>								
	19/10/2021	USD	1.000	EUR	846	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17
	19/10/2021	CHF	922	EUR	847	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/10/2021	GBP	723	EUR	848	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
	19/10/2021	USD	1.006	EUR	851	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17
	19/10/2021	GBP	729	EUR	855	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)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
<b>Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities (continuación)</b>								
	19/10/2021	SEK	8.566	EUR	842	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	19/10/2021	NOK	8.576	EUR	840	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	19/10/2021	NOK	8.591	EUR	841	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	19/10/2021	GBP	41.528.032	EUR	48.674.009	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(376.078)
	19/10/2021	USD	1.003	EUR	849	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17
	19/10/2021	CHF	928	EUR	853	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/10/2021	USD	1.000	EUR	846	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17
	19/10/2021	GBP	726	EUR	850	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
	19/10/2021	USD	999	EUR	845	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17
	19/10/2021	GBP	726	EUR	851	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
	19/10/2021	USD	1.005	EUR	850	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17
	19/10/2021	GBP	733	EUR	859	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
	27/10/2021	EUR	11.864.298	USD	13.910.160	Operaciones comerciales	Barclays	(131.838)
	27/10/2021	EUR	13.328.826	GBP	11.400.437	Operaciones comerciales	Barclays	71.795
	27/10/2021	GBP	68.893	EUR	79.969	Operaciones comerciales	JP Morgan Chase New York	143
								<b>(435.880) EUR</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha</b>								
	19/10/2021	USD	54.326	EUR	45.951	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	907
	19/10/2021	GBP	852.236	EUR	998.886	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7.718)
	19/10/2021	GBP	11.323.149	EUR	13.271.592	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(102.542)
	19/10/2021	GBP	776	EUR	910	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
	19/10/2021	CHF	79.116	EUR	72.669	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	519
	19/10/2021	GBP	238	EUR	278	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/10/2021	EUR	173.326	GBP	150.000	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.128)
								<b>(109.971) EUR</b>
<b>Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha</b>								
	19/10/2021	EUR	2.382.594	USD	2.816.839	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(54.502)
	19/10/2021	EUR	6.828	USD	8.073	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(156)
	19/10/2021	EUR	11.048	USD	13.061	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(253)
	19/10/2021	USD	2	EUR	1	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	765	USD	905	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(18)
	19/10/2021	EUR	6	USD	7	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	98.299	EUR	83.758	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.191
	19/10/2021	USD	282	EUR	240	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	19/10/2021	USD	457	EUR	390	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/10/2021	EUR	453	USD	531	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
	19/10/2021	EUR	30	USD	35	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	37	USD	43	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2021	EUR	31	USD	36	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	6.751	USD	7.843	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17)
								<b>(53.753) USD</b>

## Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
<b>Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha</b>	19/10/2021	EUR	2.352.999	USD	2.781.849	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(53.825)
	19/10/2021	EUR	281.398	USD	332.685	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6.437)
	19/10/2021	USD	73.581	EUR	62.696	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	892
	19/10/2021	USD	8.831	EUR	7.524	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	107
	19/10/2021	USD	75.676	EUR	64.791	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	558
	19/10/2021	USD	9.084	EUR	7.777	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	67
								<b>(58.638) USD</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities</b>	19/10/2021	EUR	2.662.169	USD	3.147.368	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(60.897)
	19/10/2021	CHF	1.521.478	USD	1.652.595	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20.807)
	19/10/2021	GBP	764.147	USD	1.058.876	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(28.512)
	19/10/2021	EUR	1.482.489	USD	1.752.683	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(33.912)
	19/10/2021	EUR	5.979.577	USD	7.069.397	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(136.783)
	19/10/2021	GBP	62.831.058	USD	87.064.746	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.344.352)
	19/10/2021	SGD	2.813.232	USD	2.094.815	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(22.687)
	19/10/2021	GBP	1.521.542	USD	2.108.395	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(56.772)
	19/10/2021	EUR	28.792	USD	34.039	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(659)
	19/10/2021	CHF	945	USD	1.027	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13)
	19/10/2021	USD	279	GBP	201	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
	19/10/2021	USD	1.075	EUR	(910)	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	20
	19/10/2021	GBP	14.843	USD	20.558	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(544)
	19/10/2021	USD	86.328	SGD	115.849	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	998
	19/10/2021	GBP	2.352	USD	3.258	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(86)
	19/10/2021	USD	577	GBP	417	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15
	19/10/2021	USD	13.180	EUR	11.142	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	262
	19/10/2021	USD	3.197	GBP	2.308	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	85
	19/10/2021	SGD	57.374	USD	42.754	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(494)
	19/10/2021	USD	70.679	GBP	51.021	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.883
	19/10/2021	EUR	47.016	USD	55.473	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(964)
	19/10/2021	CHF	26.870	USD	29.171	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(353)
	19/10/2021	GBP	13.508	USD	18.664	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(450)
	19/10/2021	EUR	26.141	USD	30.843	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(536)
	19/10/2021	EUR	105.746	USD	124.769	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.169)
	19/10/2021	GBP	1.115.391	USD	1.541.124	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(37.148)
	19/10/2021	SGD	48.486	USD	36.119	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(406)
	19/10/2021	GBP	26.190	USD	36.187	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(872)
	19/10/2021	EUR	510	USD	602	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10)
	19/10/2021	CHF	17	USD	18	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	1.122	USD	1.327	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(26)
	19/10/2021	GBP	100	USD	139	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
	19/10/2021	USD	6.658	EUR	5.630	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	131
	19/10/2021	USD	17.902	EUR	15.138	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	351
	19/10/2021	USD	15.369	GBP	11.113	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	385
	19/10/2021	SGD	3.546	USD	2.644	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(32)
	19/10/2021	GBP	10.050	USD	13.899	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(348)

## Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
<b>Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities</b> (continuación)								
	19/10/2021	USD	32.574	EUR	27.658	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	508
	19/10/2021	USD	17.088	CHF	15.833	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	107
	19/10/2021	USD	10.930	GBP	7.922	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	248
	19/10/2021	USD	18.089	EUR	15.359	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	282
	19/10/2021	USD	72.605	EUR	61.647	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.133
	19/10/2021	USD	896.809	GBP	650.009	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	20.347
	19/10/2021	USD	21.241	SGD	28.586	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	186
	19/10/2021	USD	21.167	GBP	15.342	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	480
	19/10/2021	USD	351	EUR	298	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
	19/10/2021	USD	11	CHF	10	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	6.120	EUR	5.200	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	92
	19/10/2021	GBP	2.890	USD	3.980	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(83)
	19/10/2021	EUR	4.434	USD	5.219	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(78)
	19/10/2021	USD	1.028.827	GBP	747.103	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	21.444
	19/10/2021	GBP	500	USD	689	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14)
	19/10/2021	USD	35.029	EUR	29.890	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	375
	19/10/2021	USD	18.501	CHF	17.242	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
	19/10/2021	USD	11.753	GBP	8.586	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	175
	19/10/2021	USD	19.486	EUR	16.628	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	209
	19/10/2021	USD	78.305	EUR	66.817	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	838
	19/10/2021	USD	949.672	GBP	693.809	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	14.151
	19/10/2021	USD	22.857	SGD	30.914	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	87
	19/10/2021	USD	22.690	GBP	16.577	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	338
	19/10/2021	USD	379	EUR	323	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
	19/10/2021	USD	12	CHF	11	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	225.247	EUR	191.809	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.866
	19/10/2021	USD	1.768	EUR	1.505	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	23
	19/10/2021	USD	9.305	GBP	6.768	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	179
	19/10/2021	SGD	10.192	USD	7.559	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(52)
	19/10/2021	GBP	2.095	USD	2.880	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(55)
	19/10/2021	USD	48.905	EUR	41.671	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	593
	19/10/2021	USD	25.635	CHF	23.766	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	146
	19/10/2021	USD	16.467	GBP	12.047	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	223
	19/10/2021	USD	23.721	EUR	20.212	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	288
	19/10/2021	USD	108.985	EUR	92.863	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.321
	19/10/2021	USD	1.326.578	GBP	970.519	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17.945
	19/10/2021	USD	32.051	SGD	43.314	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	147
	19/10/2021	USD	31.747	GBP	23.226	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	429
	19/10/2021	USD	527	EUR	449	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/10/2021	USD	16	CHF	15	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	245	USD	288	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
	19/10/2021	USD	7.416	EUR	6.322	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	87
	19/10/2021	USD	50.410	SGD	68.125	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	232
	19/10/2021	GBP	5.450	USD	7.451	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(102)
	19/10/2021	USD	40.706	EUR	34.701	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	473
	19/10/2021	USD	587	EUR	500	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)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
<b>Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities</b> (continuación)								
	19/10/2021	EUR	1.157	USD	1.357	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(16)
	19/10/2021	USD	521	GBP	382	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	19/10/2021	USD	16.126	GBP	11.819	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	189
	19/10/2021	EUR	30.734	USD	36.027	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(394)
	19/10/2021	CHF	17.901	USD	19.375	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(177)
	19/10/2021	GBP	9.020	USD	12.315	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(152)
	19/10/2021	EUR	15.042	USD	17.633	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(193)
	19/10/2021	EUR	70.243	USD	82.339	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(901)
	19/10/2021	GBP	734.270	USD	1.002.472	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12.394)
	19/10/2021	SGD	31.743	USD	23.510	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(129)
	19/10/2021	GBP	17.463	USD	23.842	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(295)
	19/10/2021	EUR	340	USD	398	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
	19/10/2021	CHF	11	USD	12	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	47.732	EUR	40.663	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	588
	19/10/2021	USD	38.861	CHF	35.844	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	418
	19/10/2021	EUR	43	USD	50	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2021	USD	9.665	GBP	7.083	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	115
	19/10/2021	USD	2.466	SGD	3.332	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12
	19/10/2021	GBP	212	USD	289	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
	19/10/2021	USD	19.087	GBP	13.887	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	363
	19/10/2021	EUR	299	USD	351	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
	19/10/2021	GBP	19.769	USD	27.173	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(517)
	19/10/2021	SGD	33.483	USD	24.860	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(197)
	19/10/2021	USD	14.000	GBP	10.186	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	266
	19/10/2021	EUR	44.884	USD	52.575	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(537)
	19/10/2021	CHF	25.808	USD	27.851	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(172)
	19/10/2021	GBP	13.227	USD	18.085	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(250)
	19/10/2021	EUR	22.282	USD	26.100	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(267)
	19/10/2021	EUR	103.823	USD	121.613	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.243)
	19/10/2021	GBP	1.084.040	USD	1.482.158	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20.455)
	19/10/2021	SGD	47.322	USD	34.968	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(113)
	19/10/2021	GBP	25.741	USD	35.195	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(486)
	19/10/2021	EUR	502	USD	588	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
	19/10/2021	CHF	16	USD	18	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	EUR	98	USD	115	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2021	EUR	2.125	USD	2.490	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(26)
	19/10/2021	SGD	10.168	USD	7.509	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20)
	19/10/2021	GBP	100	USD	137	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	19/10/2021	EUR	47.483	USD	55.476	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(425)
	19/10/2021	CHF	27.357	USD	29.471	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(131)
	19/10/2021	GBP	13.837	USD	18.948	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(290)
	19/10/2021	EUR	23.553	USD	27.517	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(211)
	19/10/2021	EUR	110.025	USD	128.545	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(984)
	19/10/2021	GBP	1.147.399	USD	1.571.190	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(24.057)
	19/10/2021	SGD	50.448	USD	37.229	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(71)
	19/10/2021	GBP	27.138	USD	37.161	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(569)

## Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
<b>Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities</b> (continuación)								
	19/10/2021	EUR	532	USD	622	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
	19/10/2021	CHF	17	USD	19	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	828	EUR	707	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	19/10/2021	GBP	410	USD	562	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
	19/10/2021	EUR	734	USD	859	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8)
	19/10/2021	USD	191	GBP	139	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	19/10/2021	SGD	31.082	USD	22.958	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(64)
	19/10/2021	GBP	162	USD	223	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
	19/10/2021	CHF	1.321	USD	1.423	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
	19/10/2021	USD	4.447	EUR	3.808	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	32
	19/10/2021	USD	1.438	EUR	1.231	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
	19/10/2021	GBP	99	USD	135	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	19/10/2021	USD	21.825	SGD	29.630	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2021	GBP	4.654	USD	6.299	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(24)
	19/10/2021	USD	37.709	EUR	32.496	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	34
	19/10/2021	USD	20.018	CHF	18.696	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(34)
	19/10/2021	USD	12.795	GBP	9.514	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(33)
	19/10/2021	USD	18.742	EUR	16.151	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17
	19/10/2021	USD	86.578	EUR	74.609	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	78
	19/10/2021	USD	1.050.541	GBP	781.119	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.707)
	19/10/2021	USD	25.213	SGD	34.336	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(78)
	19/10/2021	USD	24.934	GBP	18.539	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(64)
	19/10/2021	USD	419	EUR	361	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	USD	13	CHF	12	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	19/10/2021	GBP	173	USD	232	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	19/10/2021	USD	931	EUR	802	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	19/10/2021	EUR	2.122.186	USD	2.465.700	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5.277)
	19/10/2021	USD	2.029.415	GBP	1.511.643	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8.862)
	19/10/2021	SGD	27.797	USD	20.429	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	46
	19/10/2021	GBP	23.026	USD	30.913	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	135
								<b>(2.740.648) USD</b>

## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

A 30 de septiembre de 2021, Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de incumplimiento crediticio:

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado USD	% del patrimonio neto
CDS	JPMorgan	Airbus SE	Venta	EUR	1.300.000	20/06/2025	36.410	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 35	Compra	EUR	13.300.000	20/06/2026	(1.796.821)	(0,33)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 35	Compra	EUR	22.750.000	20/06/2026	(687.696)	(0,13)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 35	Compra	EUR	6.725.000	20/06/2026	(908.543)	(0,17)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 35	Venta	EUR	2.200.000	20/06/2026	297.219	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 35	Venta	EUR	5.000.000	20/06/2026	151.142	0,03
CDS	JPMorgan	Lloyds Banking Group	Compra	EUR	3.300.000	20/06/2026	(36.542)	(0,01)
CDS	Goldman Sachs	Scottish & Southern Energy plc	Compra	EUR	1.400.000	20/06/2026	(34.823)	(0,01)
CDS	Goldman Sachs	Banco Bilbao Vizcaya	Compra	EUR	1.200.000	20/06/2026	(25.693)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	74.000	20/06/2022	(2.717)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	150.000	20/06/2022	(5.507)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	295.000	20/06/2022	(10.830)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	185.000	20/06/2022	(6.792)	(0,00)
CDS	JPMorgan	BCP Finance Bank	Compra	EUR	55.000	20/06/2022	(1.353)	(0,00)
CDS	JPMorgan	BCP Finance Bank	Compra	EUR	55.000	20/06/2022	(1.353)	(0,00)
CDS	Barclays	Banca BPM SPA	Compra	EUR	146.000	20/06/2022	(5.360)	(0,00)
CDS	JPMorgan	BCP Finance Bank	Compra	EUR	60.000	20/06/2022	(1.476)	(0,00)
CDS	JPMorgan	BCP Finance Bank	Compra	EUR	80.000	20/06/2022	(1.968)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Compra	EUR	580.000	20/12/2023	(56.238)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Compra	EUR	200.000	20/12/2023	(19.393)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Banco Commercial Portugues SA	Compra	EUR	50.000	20/12/2023	(1.230)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Glencore International	Venta	EUR	1.100.000	20/06/2026	228.092	0,04
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 35	Venta	EUR	17.750.000	20/06/2026	536.554	0,10
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Compra	EUR	17.750.000	20/12/2026	(537.179)	(0,10)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Compra	EUR	17.825.000	20/12/2026	(2.438.632)	(0,44)
CDS	Goldman Sachs	Fortum OYJ	Compra	EUR	1.900.000	20/12/2026	(63.909)	(0,01)
CDS	Goldman Sachs	Veolia Environment	Compra	EUR	2.000.000	20/12/2026	(85.520)	(0,02)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 35	Venta	EUR	17.825.000	20/06/2026	2.408.145	0,44
CDS	JPMorgan	Telia Co AB	Compra	EUR	2.500.000	20/12/2026	(105.850)	(0,02)
CDS	JPMorgan	Swedbank AB	Compra	EUR	2.330.000	20/12/2026	(99.924)	(0,02)
CDS	Barclays	Standard Chartered plc	Compra	EUR	4.740.000	20/12/2026	(107.209)	(0,02)
							<b>(3.384.996) USD</b>	<b>(0,62)</b>

A 30 de septiembre de 2021, Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de incumplimiento crediticio:

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado EUR	% del patrimonio neto
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 35	Compra	EUR	17.230.000	20/06/2026	(449.403)	(0,35)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 35	Compra	EUR	2.950.000	20/06/2026	(343.883)	(0,27)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 35	Compra	EUR	4.600.000	20/06/2026	(119.980)	(0,09)

## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

(continuación)

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado EUR	% del patrimonio neto
CDS	JPMorgan	Glencore International	Venta	EUR	400.000	20/06/2026	71.567	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Compra	EUR	2.950.000	20/12/2026	(348.236)	(0,27)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Compra	EUR	21.830.000	20/12/2026	(570.047)	(0,46)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 35	Venta	EUR	21.830.000	20/06/2026	569.383	0,45
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 35	Venta	EUR	2.950.000	20/06/2026	343.883	0,27
							<b>(846.716) EUR</b>	<b>(0,67)</b>

A 30 de septiembre de 2021, Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de incumplimiento crediticio:

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado EUR	% del patrimonio neto
CDS	JPMorgan	ITRAXX Europe Crossover Series 31	Venta	EUR	933.340	20/06/2022	27.465	0,03
CDS	Goldman Sachs	Cellnex Telecom SA	Venta	EUR	300.000	20/06/2022	10.581	0,01
							<b>38.046 EUR</b>	<b>0,04</b>

A 30 de septiembre de 2021, Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de incumplimiento crediticio:

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado EUR	% del patrimonio neto
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Compra	EUR	325.000	20/12/2023	(27.191)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Airbus SE	Venta	EUR	900.000	20/06/2025	21.750	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 35	Compra	EUR	30.520.000	20/06/2026	(796.040)	(0,36)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 35	Compra	EUR	18.600.000	20/06/2026	(2.168.210)	(0,97)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.36	Compra	USD	8.730.000	20/06/2026	(181.358)	(0,08)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 35	Compra	EUR	4.340.000	20/06/2026	(4.713)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.36	Compra	USD	9.000.000	20/06/2026	(186.967)	(0,08)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 35	Compra	EUR	5.000.000	20/06/2026	(130.413)	(0,06)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 35	Compra	EUR	4.000.000	20/06/2026	(466.282)	(0,21)
CDS	JPMorgan	Barclays plc	Compra	EUR	1.700.000	20/06/2026	(8.519)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Lloyds Banking Group	Compra	EUR	1.700.000	20/06/2026	(16.243)	(0,01)
CDS	Goldman Sachs	SSE plc	Compra	EUR	1.870.000	20/06/2026	(40.134)	(0,02)
CDS	Goldman Sachs	Banco Bilbao Vizcaya	Compra	EUR	800.000	20/06/2026	(14.779)	(0,01)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	61.000	20/06/2022	(1.932)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	120.000	20/06/2022	(3.801)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	245.000	20/06/2022	(7.761)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	150.000	20/06/2022	(4.751)	(0,00)
CDS	Barclays	Coöperatieve Rabobank U.A.	Compra	EUR	900.000	20/12/2026	(10.421)	(0,00)
CDS	JPMorgan	BCP Finance Bank	Compra	EUR	165.000	20/06/2022	(3.502)	(0,00)
CDS	JPMorgan	BCP Finance Bank	Compra	EUR	165.000	20/06/2022	(3.502)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	124.000	20/06/2022	(3.928)	(0,00)
CDS	JPMorgan	BCP Finance Bank	Compra	EUR	165.000	20/06/2022	(3.502)	(0,00)
CDS	JPMorgan	BCP Finance Bank	Compra	EUR	235.000	20/06/2022	(4.988)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Glencore International	Venta	EUR	600.000	20/06/2026	107.350	0,05
CDS	JPMorgan	General Motors Company	Compra	USD	800.000	20/06/2023	(53.878)	(0,02)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 36	Compra	EUR	4.340.000	20/12/2026	20.962	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 35	Venta	EUR	4.340.000	20/06/2026	4.713	0,00

## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

(continuación)

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado EUR	% del patrimonio neto
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Compra	EUR	35.520.000	20/12/2026	(927.533)	(0,41)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 35	Venta	EUR	35.520.000	20/06/2026	926.453	0,41
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Compra	EUR	22.600.000	20/12/2026	(2.667.846)	(1,19)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 35	Venta	EUR	22.600.000	20/06/2026	2.634.491	1,18
CDS	Goldman Sachs	Fortum OYJ	Compra	EUR	2.200.000	20/12/2026	(63.851)	(0,03)
CDS	Goldman Sachs	Veolia Environment	Compra	EUR	1.750.000	20/12/2026	(64.567)	(0,03)
CDS	JPMorgan	Electricite DE	Compra	EUR	1.300.000	20/12/2026	(32.864)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Diamler AG	Compra	EUR	537.500	20/12/2026	(13.416)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Tesco plc	Compra	EUR	2.200.000	20/12/2026	(34.212)	(0,02)
CDS	Barclays	Standard Chartered plc	Compra	EUR	2.190.000	20/12/2026	(42.740)	(0,02)
CDS	JPMorgan	Telia Co AB	Compra	EUR	1.700.000	20/12/2026	(62.106)	(0,03)
CDS	JPMorgan	Swedbank AB	Compra	EUR	2.160.000	20/12/2026	(79.929)	(0,05)
							<b>(4.416.160) EUR</b>	<b>(1,97)</b>

A 30 de septiembre de 2021, Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de incumplimiento crediticio:

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado USD	% del patrimonio neto
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 35	Venta	EUR	3.600.000	20/06/2026	486.357	0,92
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.36	Venta	USD	3.890.000	20/06/2026	93.656	0,18
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.36	Compra	USD	550.000	20/06/2026	(13.242)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.36	Compra	USD	3.340.000	20/06/2026	(80.414)	(0,15)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.37	Venta	USD	3.340.000	20/12/2026	79.704	0,15
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	3.600.000	20/12/2026	492.515	0,94
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 35	Compra	EUR	3.600.000	20/06/2026	(486.358)	(0,92)
							<b>572.218 USD</b>	<b>1,09</b>

A 30 de septiembre de 2021, Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de incumplimiento crediticio:

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado USD	% del patrimonio neto
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	100.000	20/12/2023	(12.302)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 35	Compra	EUR	3.150.000	20/06/2026	(95.219)	(0,06)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 35	Compra	EUR	100.000	20/06/2026	(13.510)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 35	Venta	EUR	870.000	20/06/2026	26.299	0,02
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 35	Compra	EUR	75.000	20/06/2026	(10.132)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Barclays plc	Compra	EUR	80.000	20/06/2026	(465)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	SSE plc	Compra	EUR	70.000	20/06/2026	(1.741)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 35	Compra	EUR	80.000	20/06/2026	(10.808)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 35	Compra	EUR	400.000	20/06/2026	(12.091)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 35	Venta	EUR	400.000	20/06/2026	12.091	0,01



## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

(continuación)

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado USD	% del patrimonio neto
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 35	Venta	EUR	900.000	20/06/2026	27.206	0,02
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 35	Venta	EUR	2.250.000	20/06/2026	68.014	0,04
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Compra	EUR	2.250.000	20/12/2026	(68.094)	(0,04)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Compra	EUR	255.000	20/12/2026	(34.886)	(0,02)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 35	Venta	EUR	255.000	20/06/2026	34.450	0,02
CDS	Goldman Sachs	Fortum OYJ	Compra	EUR	90.000	20/12/2026	(3.027)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Veolia Environment	Compra	EUR	70.000	20/12/2026	(2.993)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Venta	EUR	870.000	20/12/2026	26.329	0,02
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 35	Compra	EUR	870.000	20/06/2026	(26.299)	(0,02)
CDS	JPMorgan	Telia Co AB	Compra	EUR	90.000	20/12/2026	(3.811)	(0,00)
CDS	Barclays	Standard Chartered plc	Compra	EUR	130.000	20/12/2026	(2.940)	(0,00)
							<b>(103.929) USD</b>	<b>(0,06)</b>

A 30 de septiembre de 2021, Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de rentabilidad total:

Descripción	Contraparte	Subyacente/ Emisor	Pagar/Recibir	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
SRT	Bank of America Merrill Lynch	North America Equity Basket	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 21 acciones y recibe US-1M-LIBOR.	USD	3.871.104	20/04/2022	43.450	0,19
SRT	UBS	North America Equity Basket	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 23 acciones y recibe US-1M-LIBOR.	USD	4.541.802	26/06/2023	(9.074)	(0,04)
							<b>34.376 USD</b>	<b>0,15</b>

A 30 de septiembre de 2021, Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de incumplimiento crediticio:

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado EUR	% del patrimonio neto
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	100.000	20/06/2022	(3.168)	(0,00)
CDS	Citigroup Global Markets	Societe Generale SA	Compra	EUR	19.000.000	20/06/2026	(370.425)	(0,03)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	2.855.000	20/06/2022	(90.436)	(0,01)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	5.810.000	20/06/2022	(184.039)	(0,02)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	3.645.000	20/06/2022	(115.460)	(0,01)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	1.477.000	20/06/2022	(46.786)	(0,00)
CDS	JPMorgan	BCP Finance Bank	Compra	EUR	3.765.000	20/06/2022	(79.919)	(0,01)
CDS	JPMorgan	BCP Finance Bank	Compra	EUR	3.765.000	20/06/2022	(79.919)	(0,01)
CDS	JPMorgan	BCP Finance Bank	Compra	EUR	3.765.000	20/06/2022	(79.919)	(0,01)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	2.853.000	20/06/2022	(90.372)	(0,01)
CDS	JPMorgan	BCP Finance Bank	Compra	EUR	5.185.000	20/06/2022	(110.061)	(0,01)

## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

(continuación)

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado EUR	% del patrimonio neto
CDS	JPMorgan	General Motors Company	Compra	USD	21.150.000	20/12/2022	(1.032.324)	(0,09)
CDS	Goldman Sachs	Arcelormittal	Compra	EUR	7.500.000	20/12/2023	(723.012)	(0,06)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	1.000.000	20/06/2022	(31.676)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Airbus SE	Venta	EUR	3.950.000	20/06/2025	95.456	0,01
CDS	Citigroup Global Markets	Barclays plc	Compra	EUR	7.300.000	20/06/2026	(36.584)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.36	Compra	USD	262.650.000	20/06/2026	(5.456.321)	(0,46)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 35	Compra	EUR	97.450.000	20/06/2026	(2.541.747)	(0,22)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 35	Compra	EUR	155.650.000	20/06/2026	(18.144.189)	(1,54)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSR 35	Compra	EUR	22.180.000	20/06/2026	(517.830)	(0,04)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 35	Compra	EUR	25.090.000	20/06/2026	(27.249)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.36	Compra	USD	39.000.000	20/06/2026	(810.190)	(0,07)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 35	Compra	EUR	23.500.000	20/06/2026	(2.739.405)	(0,23)
CDS	Goldman Sachs	Coöperatieve Rabobank U.A.	Compra	EUR	14.200.000	20/06/2026	(192.625)	(0,02)
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues	Compra	EUR	500.000	20/06/2022	(10.613)	(0,00)
CDS	Bank of America Merrill Lynch	Barclays plc	Compra	EUR	9.830.000	20/06/2026	(236.610)	(0,02)
CDS	Bank of America Merrill Lynch	Lloyds Banking Group	Compra	EUR	12.220.000	20/06/2026	(337.745)	(0,03)
CDS	JPMorgan	Barclays plc	Compra	EUR	5.990.000	20/06/2026	(30.019)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Lloyds Banking Group	Compra	EUR	24.700.000	20/06/2026	(235.997)	(0,02)
CDS	Goldman Sachs	Monitchem Holdco 3 S.A.	Compra	EUR	10.000.000	20/06/2026	(1.421.913)	(0,12)
CDS	Citigroup Global Markets	Sanofi SA	Compra	EUR	8.900.000	20/06/2026	(332.208)	(0,03)
CDS	JPMorgan	Henkel AG & Co	Compra	EUR	17.700.000	20/06/2026	(701.843)	(0,06)
CDS	Goldman Sachs	Banco Bilbao Vizcaya	Compra	EUR	9.700.000	20/06/2026	(179.199)	(0,02)
CDS	Barclays	Coöperatieve Rabobank U.A.	Compra	EUR	4.600.000	20/12/2026	(53.265)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	400.000	20/06/2022	(12.671)	(0,00)
CDS	JPMorgan	General Motors Company	Compra	USD	600.000	20/12/2022	(29.286)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues	Compra	EUR	900.000	20/06/2022	(19.104)	(0,00)
CDS	JPMorgan	General Motors Company	Compra	USD	1.200.000	20/12/2022	(58.572)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 35	Venta	EUR	25.090.000	20/06/2026	27.249	0,00
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 36	Compra	EUR	25.090.000	20/12/2026	121.185	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSR 36	Compra	EUR	22.180.000	20/12/2026	(502.472)	(0,04)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSR 35	Venta	EUR	22.180.000	20/06/2026	517.830	0,04
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Compra	EUR	97.450.000	20/12/2026	(2.544.708)	(0,21)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 35	Venta	EUR	97.450.000	20/06/2026	2.541.747	0,22
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Compra	EUR	179.150.000	20/12/2026	(21.147.982)	(1,80)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 35	Venta	EUR	179.150.000	20/06/2026	20.883.594	1,77

## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

(continuación)

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado EUR	% del patrimonio neto
CDS	Goldman Sachs	Veolia Environment	Compra	EUR	16.100.000	20/12/2026	(594.018)	(0,05)
CDS	JPMorgan	Electricite DE	Compra	EUR	6.250.000	20/12/2026	(158.002)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Bayerische Motoren Werke AG	Compra	EUR	10.860.000	20/12/2026	(317.621)	(0,03)
CDS	JPMorgan	Diamler AG	Compra	EUR	19.355.000	20/12/2026	(483.091)	(0,04)
CDS	BNP Paribas	British Telecommunications plc	Compra	EUR	15.000.000	20/12/2026	(134.918)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Tesco plc	Compra	EUR	16.700.000	20/12/2026	(259.703)	(0,02)
CDS	JPMorgan	Telia Co AB	Compra	EUR	15.800.000	20/12/2026	(577.225)	(0,05)
CDS	Barclays	Standard Chartered plc	Compra	EUR	13.500.000	20/12/2026	(263.463)	(0,02)
CDS	JPMorgan	Swedbank AB	Compra	EUR	18.560.000	20/12/2026	(686.794)	(0,06)
CDS	Goldman Sachs	HSBC Holdings	Compra	EUR	4.115.000	20/12/2026	(91.958)	(0,01)
CDS	Bank of America Merrill Lynch	ING Groep NV	Compra	EUR	18.300.000	20/12/2026	(148.334)	(0,01)
CDS	Goldman Sachs	HSBC Holdings	Compra	EUR	22.210.000	20/12/2026	36.428	0,00
CDS	Barclays	Natwest Group	Compra	EUR	10.540.000	20/12/2026	(85.787)	(0,01)
CDS	Citigroup Global Markets	Westpac banking Corp.	Compra	USD	23.030.000	20/12/2026	(709.295)	(0,06)
							<b>(41.644.583) EUR</b>	<b>(3,53)</b>

A 30 de septiembre de 2021, Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de incumplimiento crediticio:

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado EUR	% del patrimonio neto
CDS	Citigroup Global Markets	Tesco plc	Compra	EUR	60.000	20/06/2023	(792)	(0,00)
CDS	Citigroup Global Markets	Societe Generale SA	Compra	EUR	1.000.000	20/06/2026	(19.496)	(0,03)
CDS	JPMorgan	Pearson PLC	Compra	EUR	40.000	20/06/2023	(558)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banca Popolare Di Milano	Compra	EUR	30.000	20/06/2023	(2.021)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues	Compra	EUR	30.000	20/06/2023	(1.146)	(0,00)
CDS	Citigroup Global Markets	Tesco plc	Compra	EUR	80.000	20/06/2023	(1.056)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Airbus SE	Venta	EUR	350.000	20/06/2025	8.458	0,02
CDS	JPMorgan	Tesco plc	Compra	EUR	60.000	20/06/2023	(792)	(0,00)
CDS	Citigroup Global Markets	Barclays plc	Compra	EUR	700.000	20/06/2026	(3.508)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.36	Compra	USD	9.750.000	20/06/2026	(202.548)	(0,36)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 35	Compra	EUR	7.320.000	20/06/2026	(190.924)	(0,34)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 35	Compra	EUR	2.910.000	20/06/2026	(339.220)	(0,61)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 35	Compra	EUR	3.810.000	20/06/2026	(4.138)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.36	Compra	USD	2.000.000	20/06/2026	(41.548)	(0,07)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSR 35	Compra	EUR	1.250.000	20/06/2026	(29.183)	(0,05)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.36	Compra	USD	3.500.000	20/06/2026	(72.709)	(0,13)
CDS	Goldman Sachs	Coöperatieve Rabobank U.A.	Compra	EUR	1.300.000	20/06/2026	(17.635)	(0,03)
CDS	Bank of America Merrill Lynch	Barclays plc	Compra	EUR	350.000	20/06/2026	(8.425)	(0,02)

## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

(continuación)

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado EUR	% del patrimonio neto
CDS	Bank of America Merrill Lynch	Lloyds Banking Group	Compra	EUR	930.000	20/06/2026	(25.704)	(0,05)
CDS	JPMorgan	Barclays plc	Compra	EUR	590.000	20/06/2026	(2.957)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Lloyds Banking Group	Compra	EUR	2.600.000	20/06/2026	(24.842)	(0,04)
CDS	JPMorgan	Henkel AG & Co	Compra	EUR	1.300.000	20/06/2026	(51.548)	(0,09)
CDS	JPMorgan	Natural Energy Group SA	Compra	EUR	800.000	20/06/2026	(19.059)	(0,03)
CDS	Citigroup Global Markets	Sanofi SA	Compra	EUR	1.100.000	20/06/2026	(41.059)	(0,07)
CDS	Goldman Sachs	SSE plc	Compra	EUR	960.000	20/06/2026	(20.604)	(0,04)
CDS	Goldman Sachs	Banco Bilbao Vizcaya	Compra	EUR	650.000	20/06/2026	(12.008)	(0,02)
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Compra	EUR	30.000	20/06/2023	(1.146)	(0,00)
CDS	JPMorgan	United Utilities Group	Compra	EUR	80.000	20/12/2023	(1.543)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Compra	EUR	30.000	20/06/2023	(2.021)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Compra	EUR	145.000	20/12/2023	(12.131)	(0,02)
CDS	Barclays	Tesco plc	Compra	EUR	100.000	20/12/2023	(1.606)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Tesco plc	Compra	EUR	260.000	20/12/2023	(4.175)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Compra	EUR	250.000	20/12/2023	(20.916)	(0,04)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 36	Compra	EUR	3.810.000	20/12/2026	18.402	0,03
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 35	Venta	EUR	3.810.000	20/06/2026	4.138	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSR 35	Venta	EUR	1.250.000	20/06/2026	29.183	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSR 36	Compra	EUR	1.250.000	20/12/2026	(28.318)	(0,05)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 35	Venta	EUR	7.320.000	20/06/2026	190.924	0,34
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Compra	EUR	7.320.000	20/12/2026	(191.147)	(0,34)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Compra	EUR	2.910.000	20/12/2026	(343.515)	(0,62)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 35	Venta	EUR	2.910.000	20/06/2026	339.220	0,61
CDS	Goldman Sachs	Fortum OYJ	Compra	EUR	850.000	20/12/2026	(24.670)	(0,04)
CDS	Goldman Sachs	Veolia Environment	Compra	EUR	830.000	20/12/2026	(30.623)	(0,05)
CDS	JPMorgan	Electricite DE	Compra	EUR	400.000	20/12/2026	(10.112)	(0,02)
CDS	JPMorgan	General Motors Company	Compra	USD	500.000	20/12/2026	(85.548)	(0,15)
CDS	JPMorgan	Bayerische Motoren Werke AG	Compra	EUR	600.000	20/12/2026	(17.548)	(0,03)
CDS	JPMorgan	Diamler AG	Compra	EUR	1.077.500	20/12/2026	(26.894)	(0,05)
CDS	JPMorgan	Tesco plc	Compra	EUR	450.000	20/12/2026	(6.998)	(0,01)
CDS	Barclays	Standard Chartered plc	Compra	EUR	1.300.000	20/12/2026	(25.371)	(0,05)
CDS	JPMorgan	Telia Co AB	Compra	EUR	900.000	20/12/2026	(32.880)	(0,06)
CDS	JPMorgan	Swedbank AB	Compra	EUR	850.000	20/12/2026	(31.453)	(0,07)
CDS	Barclays	Natwest Group	Compra	EUR	1.030.000	20/12/2026	(8.383)	(0,02)
CDS	Bank of America Merrill Lynch	ING Groep NV	Compra	EUR	1.840.000	20/12/2026	(14.914)	(0,03)
CDS	Goldman Sachs	HSBC Holdings	Compra	EUR	735.000	20/12/2026	(16.425)	(0,04)
CDS	Goldman Sachs	HSBC Holdings	Compra	EUR	1.570.000	20/12/2026	2.575	0,00
CDS	Citigroup Global Markets	Westpac banking Corp.	Compra	USD	1.700.000	20/12/2026	(52.357)	(0,09)
							<b>(1.531.274) EUR</b>	<b>(2,74)</b>

**Notas a los estados financieros***(continuación)***10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS***(continuación)*

A 30 de septiembre de 2021, 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 5 acciones y recibe 1M TOIS -0,35%.	EUR	5.705.100	Del 05/05/2027 al 24/10/2029	(9.023)	(0,01)
SRT	Goldman Sachs	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la acción subyacente y recibe 1M CIBOR -0,35%.	GBP	2.600.098	Del 05/05/2027 al 24/10/2029	40.933	0,03
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 3 acciones y recibe 1M TOIS.	CHF	9.872.291	24/01/2022	86.959	0,06
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 6 acciones y recibe 1M CIBOR.	DKK	83.034.385	24/01/2022	305.316	0,21
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 27 acciones y recibe 1M EONIA.	EUR	45.924.957	24/01/2022	614.081	0,42
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 4 acciones y recibe 1M SONIA.	GBP	9.580.352	24/01/2022	117.084	0,08
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 4 acciones y recibe 1M NIBOR.	NOK	49.507.910	24/01/2022	18.400	0,01
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 13 acciones y recibe 1M STIBOR.	SEK	250.115.433	24/01/2022	329.713	0,22
							<b>1.503.463 EUR</b>	<b>1,02</b>

## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

(continuación)

A 30 de septiembre de 2021, Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de rentabilidad total:

Descripción	Contraparte	Subyacente/ Emisor	Pagar/Recibir	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
SRT	Bank of America Merrill Lynch	North America Equity Basket	Paga US-1M-LIBOR +0,30% y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 5 acciones. Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 21 acciones y recibe US-1M- LIBOR.	USD	39.587.135	20/04/2022	(1.345.932)	(1,17)
SRT	UBS	North America Equity Basket	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 23 acciones y recibe US-1M-LIBOR.	USD	13.065.166	26/06/2023	(25.832)	(0,03)
							<b>(1.371.764) USD</b>	<b>(1,20)</b>

A 30 de septiembre de 2021, Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de rentabilidad total:

Descripción	Contraparte	Subyacente/ Emisor	Pagar/Recibir	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 2 acciones y recibe AUD 1M LIBOR +0,40%.	AUD	4.225.817	24/01/2022	(48.539)	(0,05)
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga 1M CIBOR +0,35% y recibe el rendimiento de la acción subyacente.	CHF	1.645.760	01/12/2022	(46.636)	(0,04)
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga DKDRA +0,30% y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 2 acciones.	DKK	2.432.685	24/01/2022	(14.928)	(0,01)
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga 1M EURIBOR +0,35% y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 3 acciones. Paga el rendimiento de la acción subyacente y recibe 1M-EONIA.	EUR	2.551.063	24/01/2022	(100.122)	(0,09)
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga GBP 1M-LIBOR y recibe el rendimiento de la acción subyacente. Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 2 acciones y recibe GBP 1M LIBOR +0,40%.	GBP	3.194.291	24/01/2022	137.227	0,13

## 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 JPY 1M LIBOR y recibe el rendimiento de la acción subyacente.	HKD	6.143.798	24/01/2022	(40.377)	(0,04)
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga JPY 1M LIBOR y recibe el rendimiento de la acción subyacente.	JPY	25.852.000	03/06/2024	(12.368)	(0,01)
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga US 1M LIBOR +0,35% y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 26 acciones. Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 14 acciones y recibe US 1M LIBOR.	USD	58.700.008	24/01/2022	(1.879.388)	(1,75)
							<b>(2.005.131) USD</b>	<b>(1,86)</b>

A 30 de septiembre de 2021, 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	Citigroup	North America Commodities Basket	Paga el 0,14% y recibe el rendimiento de BCOMF3 Index.	USD	36.274.249	01/10/2021	354.846	0,09
SRT	Credit Suisse	North America Commodities Basket	Paga el 0,25% y recibe el rendimiento de BCOMF3 Index.	USD	34.282.743	01/10/2021	335.364	0,08
SRT	Goldman Sachs	North America Commodities Basket	Paga el 0,11% y recibe el rendimiento de BCOMF3 Index. Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 3 índices y recibe 0,11%.	USD	118.407.714	01/10/2021	957.553	0,24
SRT	JPMorgan	North America Commodities Basket	Paga del 0% al 0,27% y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 22 índices. Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 27 índices.	USD	1.701.456.615	Del 30/09/2021 al 01/10/2021	1.533.050	0,38
SRT	Macquarie	North America Commodities Basket	Paga el 0,17% y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 2 índices. Paga el rendimiento del índice subyacente.	USD	336.957.706	01/10/2021	(1.552.777)	(0,39)
							<b>1.628.036 USD</b>	<b>0,40</b>

## Notas a los estados financieros

(continuación)

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

A 30 de septiembre de 2021, la contraparte de los contratos de futuros pendientes es UBS.

A 30 de septiembre de 2021, Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
Euro-BUND Future	Ventas	(262)	EUR	(31.193.441)	08/12/2021	768.816	0,14
Euro-OAT Future	Ventas	(29)	EUR	(3.882.306)	08/12/2021	96.796	0,02
Euro-BOBL Future	Ventas	(290)	EUR	(34.592.629)	08/12/2021	263.453	0,05
Euro-BUXL 30 Year Future	Ventas	(1)	EUR	(182.657)	08/12/2021	1.136	0,00
10-Year Australian Treasury Bond Future	Compras	14	AUD	1.430.698	15/12/2021	(26.005)	(0,00)
10-Year MSE Canadian Treasury Bond Future	Compras	56	CAD	4.365.730	20/12/2021	(160.919)	(0,03)
10-Year US Treasury Note Future	Compras	166	USD	18.550.500	21/12/2021	(334.594)	(0,06)
US Treasury Bond Future	Compras	51	USD	7.384.641	21/12/2021	(230.313)	(0,04)
10-Year US Ultra Treasury Note Future	Ventas	(171)	USD	(17.580.938)	21/12/2021	476.594	0,09
US Ultra Treasury Bond Future	Ventas	(28)	USD	(3.317.125)	21/12/2021	76.884	0,01
Long GILT Future	Ventas	(152)	GBP	(27.350.471)	29/12/2021	812.979	0,14
US Treasury Bond Future	Compras	444	USD	43.636.875	31/12/2021	(386.812)	(0,07)
US Treasury Bond Future	Compras	34	USD	7.150.891	31/12/2021	(3.719)	(0,00)
						<b>1.354.296 USD</b>	<b>0,25</b>

A 30 de septiembre de 2021, Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
Euro-BUND Future	Ventas	(66)	EUR	(6.780.180)	08/12/2021	148.649	0,11
Euro-SCHATZ Future	Ventas	(4)	EUR	(405.948)	08/12/2021	320	0,00
Euro-BUXL 30 Year Future	Ventas	(3)	EUR	(472.818)	08/12/2021	4.175	0,00
10-Year US Treasury Note Future	Ventas	(4)	USD	(385.694)	21/12/2021	6.957	0,01
US Treasury Bond Future	Ventas	(5)	USD	(624.690)	21/12/2021	20.965	0,02
10-Year US Ultra Treasury Note Future	Ventas	(12)	USD	(1.064.541)	21/12/2021	33.651	0,03
Long GILT Future	Ventas	(4)	GBP	(621.036)	29/12/2021	18.960	0,01
						<b>233.677 EUR</b>	<b>0,18</b>



## Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

A 30 de septiembre de 2021, Threadneedle (Lux) - European Social Bond tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
Euro-BUND Future	Ventas	(96)	EUR	(9.862.080)	08/12/2021	116.968	0,03
Euro-BTP Future	Ventas	(3)	EUR	(327.555)	08/12/2021	3.360	0,00
Short Euro-BTP Future	Ventas	(1)	EUR	(100.869)	08/12/2021	70	0,00
10-Year US Treasury Note Future	Ventas	(41)	USD	(3.953.363)	21/12/2021	71.306	0,02
Long GILT Future	Ventas	(105)	GBP	(16.302.185)	29/12/2021	453.767	0,12
US Treasury Bond Future	Ventas	(10)	USD	(848.020)	31/12/2021	7.820	0,00
US Treasury Bond Future	Ventas	(4)	USD	(725.900)	31/12/2021	378	0,00
						<b>653.669 EUR</b>	<b>0,17</b>

A 30 de septiembre de 2021, Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
Euro-BUND Future	Ventas	(255)	EUR	(26.196.150)	08/12/2021	696.879	0,32
Euro-OAT Future	Compras	13	EUR	1.501.656	08/12/2021	(38.740)	(0,02)
Euro-BOBL Future	Ventas	(186)	EUR	(19.144.050)	08/12/2021	159.620	0,07
Euro-SCHATZ Future	Ventas	(9)	EUR	(913.383)	08/12/2021	810	0,00
Euro-BUXL 30 Year Future	Ventas	(25)	EUR	(3.940.150)	08/12/2021	164.084	0,07
10-Year US Treasury Note Future	Ventas	(36)	USD	(3.471.246)	21/12/2021	60.184	0,03
US Treasury Bond Future	Ventas	(3)	USD	(374.814)	21/12/2021	12.154	0,01
10-Year US Ultra Treasury Note Future	Ventas	(18)	USD	(1.596.812)	21/12/2021	48.778	0,02
US Ultra Treasury Bond Future	Ventas	(8)	USD	(817.766)	21/12/2021	53.443	0,02
Long GILT Future	Ventas	(151)	GBP	(23.444.095)	29/12/2021	695.681	0,31
						<b>1.852.893 EUR</b>	<b>0,83</b>

A 30 de septiembre de 2021, Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds tenía pendiente el siguiente contrato de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
10-Year US Treasury Note Future	Ventas	(48)	USD	(5.364.000)	21/12/2021	89.164	0,18
						<b>89.164 USD</b>	<b>0,18</b>

## Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

A 30 de septiembre de 2021, Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
10-Year US Ultra Treasury Note Future	Ventas	(6)	USD	(616.875)	21/12/2021	19.078	0,04
US Ultra Treasury Bond Future	Ventas	(6)	USD	(710.813)	21/12/2021	45.891	0,11
						<b>64.969 USD</b>	<b>0,15</b>

A 30 de septiembre de 2021, 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
10-Year US Treasury Note Future	Ventas	(65)	USD	(7.263.750)	21/12/2021	130.508	0,12
US Treasury Bond Future	Compras	105	USD	10.319.531	31/12/2021	(92.695)	(0,09)
						<b>37.813 USD</b>	<b>0,03</b>

A 30 de septiembre de 2021, Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond tenía pendiente el siguiente contrato de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
10-Year US Treasury Note Future	Ventas	(22)	USD	(2.458.500)	21/12/2021	44.172	0,07
						<b>44.172 USD</b>	<b>0,07</b>

A 30 de septiembre de 2021, Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
SGX MSCI Taiwan Index Future	Compras	14	USD	806.454	28/10/2021	(21.915)	(0,07)
TOPIX Index	Compras	8	JPY	1.256.207	09/12/2021	10.517	0,03
KOSPI 200 Index	Compras	12	KRW	877.785	09/12/2021	(38.368)	(0,11)
S&P 500 Future	Compras	1	USD	185.416	17/12/2021	(6.521)	(0,02)
FTSE 100 Index	Compras	8	GBP	658.358	17/12/2021	3.723	0,01
						<b>(52.564) EUR</b>	<b>(0,16)</b>

## Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

A 30 de septiembre de 2021, 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
SGX MSCI Taiwan Index Future	Compras	4	USD	267.040	28/10/2021	(7.257)	(0,01)
TOPIX Index	Compras	22	JPY	4.003.674	09/12/2021	33.520	0,06
KOSPI 200 Index	Compras	3	KRW	254.327	09/12/2021	(11.117)	(0,02)
S&P 500 Future	Ventas	(71)	USD	(15.257.013)	17/12/2021	573.326	1,08
Euro Stoxx Future	Ventas	(39)	EUR	(1.829.658)	17/12/2021	45.086	0,09
FTSE 100 Index	Compras	9	GBP	858.380	17/12/2021	8.434	0,02
						<b>641.992 USD</b>	<b>1,22</b>

A 30 de septiembre de 2021, Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
Euro-BUND Future	Ventas	(8)	EUR	(952.471)	08/12/2021	25.681	0,02
Euro-OAT Future	Ventas	(1)	EUR	(133.873)	08/12/2021	1.811	0,00
Euro-BOBL Future	Ventas	(8)	EUR	(954.279)	08/12/2021	5.679	0,00
10-Year MSE Canadian Treasury Bond Future	Compras	2	CAD	155.919	20/12/2021	(5.747)	(0,00)
10-Year US Treasury Note Future	Compras	2	USD	223.500	21/12/2021	(3.656)	(0,00)
US Treasury Bond Future	Ventas	(2)	USD	(289.594)	21/12/2021	9.391	0,01
US Ultra Treasury Bond Future	Ventas	(3)	USD	(355.406)	21/12/2021	23.883	0,01
Long GILT Future	Ventas	(3)	GBP	(539.812)	29/12/2021	16.480	0,01
US Treasury Bond Future	Compras	1	USD	98.281	31/12/2021	(883)	(0,00)
US Treasury Bond Future	Compras	2	USD	420.641	31/12/2021	(219)	(0,00)
						<b>72.420 USD</b>	<b>0,05</b>

A 30 de septiembre de 2021, Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha tenía pendiente el siguiente contrato de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
S&P 500 Future	Ventas	(44)	USD	(9.455.050)	17/12/2021	407.990	1,78
						<b>407.990 USD</b>	<b>1,78</b>

## Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

A 30 de septiembre de 2021, Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
Euro-BUND Future	Ventas	(584)	EUR	(59.994.320)	08/12/2021	1.564.187	0,13
Euro-OAT Future	Ventas	(127)	EUR	(14.670.024)	08/12/2021	365.760	0,03
Euro-BOBL Future	Ventas	(1.303)	EUR	(134.111.275)	08/12/2021	1.129.080	0,10
Euro-BUXL 30 Year Future	Ventas	(56)	EUR	(8.825.936)	08/12/2021	323.851	0,03
10-Year US Treasury Note Future	Ventas	(267)	USD	(25.745.071)	21/12/2021	464.362	0,04
US Treasury Bond Future	Ventas	(88)	USD	(10.994.542)	21/12/2021	368.976	0,03
10-Year US Ultra Treasury Note Future	Ventas	(351)	USD	(31.137.830)	21/12/2021	984.296	0,08
US Ultra Treasury Bond Future	Ventas	(9)	USD	(919.987)	21/12/2021	61.822	0,01
Long GILT Future	Ventas	(873)	GBP	(135.541.025)	29/12/2021	4.121.993	0,35
						<b>9.384.327 EUR</b>	<b>0,80</b>

A 30 de septiembre de 2021, 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-BUND Future	Ventas	(49)	EUR	(5.033.770)	08/12/2021	129.587	0,23
Euro-OAT Future	Ventas	(15)	EUR	(1.732.680)	08/12/2021	43.200	0,08
Euro-BOBL Future	Ventas	(73)	EUR	(7.513.525)	08/12/2021	62.810	0,11
Euro-SCHATZ Future	Ventas	(2)	EUR	(202.974)	08/12/2021	160	0,00
Euro-BUXL 30 Year Future	Ventas	(4)	EUR	(630.424)	08/12/2021	24.375	0,04
10-Year US Treasury Note Future	Ventas	(13)	USD	(1.253.505)	21/12/2021	22.609	0,04
US Treasury Bond Future	Ventas	(7)	USD	(874.566)	21/12/2021	29.350	0,05
10-Year US Ultra Treasury Note Future	Ventas	(35)	USD	(3.104.912)	21/12/2021	98.149	0,18
US Ultra Treasury Bond Future	Ventas	(1)	USD	(102.221)	21/12/2021	6.869	0,01
Long GILT Future	Ventas	(57)	GBP	(8.849.758)	29/12/2021	263.425	0,48
						<b>680.534 EUR</b>	<b>1,22</b>

## Notas a los estados financieros

(continuación)

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

(continuación)

A 30 de septiembre de 2021, Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities tenía pendiente el siguiente contrato de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
90 Day Eurodollar Future	Ventas	(500)	USD	(124.818.750)	14/03/2022	(43.750)	(0,01)
						<b>(43.750) USD</b>	<b>(0,01)</b>

### 12 OPCIONES AL VALOR DE MERCADO

A 30 de septiembre de 2021, 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
<b>Opciones sobre futuros</b>								
Call S&P 500 Index	UBS	4.530,000	USD	(89)	15/10/2021	1.203.404*	(18.423)	(0,01)
Call DJ Euro STOXX 50	UBS	4.225,000	EUR	(127)	15/10/2021	496.095*	(6.035)	(0,00)
Call FTSE 100 Index	UBS	7.150,000	GBP	(46)	15/10/2021	1.674.175*	(36.904)	(0,03)
						<b>(61.362) USD</b>	<b>(0,04)</b>	

\* El compromiso en posiciones cortas de compra es ilimitado.

### 13 AGRUPACIÓN

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

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

A 30 de septiembre de 2021, la SICAV no tenía una agrupación de activos. Sin embargo, la cartera Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return Portfolio para fines de gestión de inversiones se divide por clases de activos en diversas cestas que solo ella posee.

### 14 CAMBIOS EN LA COMPOSICIÓN DE ESTADOS DE LA CARTERA

Los cambios en los Estados de la Cartera están disponibles para los Accionistas previa solicitud y de forma gratuita en el domicilio social de la SICAV.

### 15 AJUSTE DE DILUCIÓN

Las Carteras pueden sufrir una reducción del Valor liquidativo por Acción debido a los diferenciales de negociación, los costes operativos y las tasas impositivas que surgen cuando las compras y las ventas de inversiones subyacentes las realiza el Subasesor para acomodar las entradas de efectivo y las salidas de capital, lo que se conoce como «dilución». Se podrá aplicar un ajuste de dilución para proteger a los Accionistas de las Carteras contrarrestando el impacto de la dilución (el «Ajuste de dilución»). Si la actividad neta de capital (incluidas suscripciones, reembolsos y conversiones en una Cartera determinada) en una Fecha de valoración determinada supera el umbral establecido ocasionalmente por la Sociedad Gestora para dicha Cartera, el Valor liquidativo de la Cartera podrá ajustarse al alza o a la baja para reflejar las entradas netas y las salidas netas, respectivamente.

El Valor liquidativo por Acción de cada Clase de Acciones de la Cartera se calcula por separado, pero cualquier Ajuste de dilución tendrá un efecto idéntico en el Valor liquidativo por Acción de cada Clase de Acciones de la Cartera. La Sociedad Gestora establecerá el importe del Ajuste de dilución para reflejar los diferenciales de negociación, los costes operativos y los impuestos estimados en los que pueda incurrir la Cartera; estos costes pueden variar en función de las condiciones del mercado y la composición de la cartera. Por lo tanto, el Ajuste de dilución puede modificarse ocasionalmente. Dichos Ajustes de dilución podrán variar de Cartera a Cartera y entre las entradas y salidas de capital diarias netas, pero no superarán el 2% del Valor liquidativo por Acción original, excepto en el caso de Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity\* Portfolio, para la cual el Ajuste de dilución no superará el 5% del Valor liquidativo por Acción original. Se realiza una revisión periódica para verificar la idoneidad de los Ajustes de dilución que se están aplicando. En el curso habitual de las actividades, la aplicación del Ajuste de dilución se activará de forma mecánica y coherente. Sin embargo, la Sociedad Gestora se reserva el derecho de realizar un Ajuste

## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 15 AJUSTE DE DILUCIÓN

(continuación)

discrecional de la dilución si, en su opinión, dicha acción redunde 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](http://www.columbiathreadneedle.com) se publican las estimaciones del importe del Ajuste de dilución basado en los valores de cada Cartera y las condiciones de mercado en el momento de la emisión del Folleto, en julio de 2021.

A 30 de septiembre de 2021, no se ha aplicado ningún Ajuste de dilución.

\* Consulte la nota 1.

### 16 COSTES OPERATIVOS

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

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond <sup>1</sup>	USD	n/d
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond <sup>1</sup>	EUR	n/d
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	EUR	7.224
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond <sup>1</sup>	EUR	n/d
Threadneedle (Lux) - European Social Bond <sup>1</sup>	EUR	n/d
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond <sup>1</sup>	EUR	n/d
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds <sup>1</sup>	USD	n/d
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt <sup>1</sup>	USD	n/d
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds <sup>1</sup>	USD	n/d
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond <sup>1</sup>	USD	n/d
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond <sup>1</sup>	USD	n/d
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	EUR	343
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	USD	9.586
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	USD	20.557
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	USD	3.123
Threadneedle (Lux) - Global Focus	USD	341.071
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	USD	52.318
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	USD	114.564
Threadneedle (Lux) - Global Select	USD	137.783
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	EUR	845.500
Threadneedle (Lux) - American	USD	118.237
Threadneedle (Lux) - American Select	USD	85.844
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	USD	78.886
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	USD	224.331
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	USD	301.951
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	USD	53.858
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	USD	9.279
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	EUR	240.767
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	EUR	51.588
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	EUR	184.022
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	EUR	289.228
Threadneedle (Lux) - European Select	EUR	577.091
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	EUR	213.235
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	USD	35.296
Threadneedle (Lux) - Global Technology	USD	90.296
Threadneedle (Lux) - UK Equities	GBP	377.172
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	GBP	174.434
Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity <sup>2</sup>	USD	59.989
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	USD	3.719
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities <sup>1</sup>	EUR	n/d
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities <sup>1</sup>	EUR	n/d
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	EUR	343.425

## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 16 COSTES OPERATIVOS

(continuación)

Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	USD	18.561
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	USD	55.933
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	USD	1.376

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 con el título «Ganancia/(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones» y «Cambio en la ganancia/(pérdida) neta no realizada en inversiones».

<sup>1</sup> 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.

<sup>2</sup> Consulte la nota 1.

### 17 INFORMACIÓN SOBRE GARANTÍAS

La siguiente tabla muestra los saldos de garantía en efectivo adeudados a y por los corredores a 30 de septiembre de 2021:

Carteras	Contraparte	Tipo de inversión	Divisa	Garantía en efectivo
<b>Debidas por los corredores - Garantías pagadas</b>				
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	JPM Securities	Contratos a plazo y swaps	USD	110.000
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	Goldman Sachs	Swaps	USD	270.000
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	JPM Chase	Contratos a plazo y swaps	USD	10.490.000
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	JPM Chase	Contratos a plazo	EUR	10.000
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	Barclays	Contratos a plazo	EUR	370.000
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	JPM Securities	Contratos a plazo y swaps	EUR	50.000
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	JPM Chase	Contratos a plazo y swaps	EUR	1.350.000
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	JPM Chase	Contratos a plazo	EUR	290.000
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	Citigroup Global Markets	Contratos a plazo	EUR	270.000
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	Goldman Sachs	Contratos a plazo y swaps	EUR	110.000
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	JPM Securities	Contratos a plazo y swaps	EUR	220.000
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	JPM Chase	Contratos a plazo	USD	660.000
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	JPM Chase	Contratos a plazo	USD	650.000
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	JPM Chase	Contratos a plazo	USD	1.400.000
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	JPM Chase	Contratos a plazo	USD	250.000
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	JPM Chase	Contratos a plazo	USD	280.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	JPM Chase	Contratos a plazo y swaps	USD	1.710.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	Barclays	Contratos a plazo y swaps	USD	10.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	HSBC	Contratos a plazo	USD	10.000
Threadneedle (Lux) - Global Focus	JPM Chase	Contratos a plazo	USD	3.390.000
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	JPM Chase	Contratos a plazo	USD	20.000
Threadneedle (Lux) - American	JPM Chase	Contratos a plazo	USD	2.870.000
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	JPM Chase	Contratos a plazo	USD	120.000
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	JPM Chase	Contratos a plazo	USD	1.340.000
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	JPM Chase	Contratos a plazo	EUR	20.000
Threadneedle (Lux) - Global Technology	JPM Chase	Contratos a plazo	USD	2.560.000
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	UBS	Swaps	USD	160.000
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	JPM Chase	Contratos a plazo	USD	590.000
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	Bank of America Merrill Lynch	Swaps	USD	10.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	JPM Chase	Contratos a plazo y swaps	EUR	170.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Goldman Sachs	Swaps	EUR	3.130.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	JPM Securities	Contratos a plazo y swaps	EUR	4.830.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Citigroup Global Markets	Swaps	EUR	1.440.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Bank of America Merrill Lynch	Swaps	EUR	920.000
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	Goldman Sachs	Swaps	EUR	110.000
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	Citigroup Global Markets	Swaps	EUR	130.000
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	JPM Securities	Contratos a plazo y swaps	EUR	300.000
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	JPM Chase	Contratos a plazo y swaps	EUR	690.000

## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 17 INFORMACIÓN SOBRE GARANTÍAS

(continuación)

Carteras	Contraparte	Tipo de inversión	Divisa	Garantía en efectivo
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	JPM Chase	Contratos a plazo	EUR	160.000
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	UBS	Swaps	USD	270.000
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Bank of America Merrill Lynch	Swaps	USD	1.089.000
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	UBS	Swaps	USD	2.860.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Macquarie	Swaps	USD	1.740.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	JPM Chase	Contratos a plazo y swaps	USD	2.780.000
<b>Debidas a los corredores - Garantías recibidas</b>				
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	Barclays	Contratos a plazo y swaps	USD	2.320.000
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	JPM Securities	Contratos a plazo y swaps	EUR	120.000
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	Barclays	Contratos a plazo	EUR	200.000
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	HSBC	Contratos a plazo	EUR	320.000
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	Barclays	Contratos a plazo y swaps	EUR	350.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	Lloyds	Contratos a plazo	USD	470.000
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	JPM Chase	Contratos a plazo	EUR	90.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	JPM Chase	Contratos a plazo	EUR	80.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	JPM Chase	Contratos a plazo	EUR	1.010.000
Threadneedle (Lux) - European Select	JPM Chase	Contratos a plazo	EUR	10.000
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	JPM Chase	Contratos a plazo	EUR	10.000
Threadneedle (Lux) - UK Equities	JPM Chase	Contratos a plazo	GBP	330.000
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	JPM Chase	Contratos a plazo	GBP	210.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Barclays	Contratos a plazo y swaps	EUR	370.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	Goldman Sachs	Swaps	EUR	740.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	UBS	Swaps	EUR	3.860.000

A 30 de septiembre de 2021, no hay valores adeudados a y por los corredores de bolsa como garantía.

### 18 INVERSIÓN CRUZADA EN CARTERAS

A 30 de septiembre de 2021, Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return Portfolio invierte en acciones de las siguientes Carteras:

Cartera de inversión cruzada	Divisa	Valor de mercado	% del patrimonio neto en la divisa base de la cartera de inversión cruzada
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	EUR	1.972.995	0,57
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	EUR	2.614.853	2,06
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	EUR	747.607	0,80
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	EUR	3.297.984	5,91
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	EUR	2.260.957	0,41
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	EUR	3.272.845	3,19
Threadneedle (Lux) - Global Focus	EUR	2.627.446	0,14
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	EUR	1.297.411	0,06

A 30 de septiembre de 2021, Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return Portfolio invierte en acciones de las siguientes Carteras:

Cartera de inversión cruzada	Divisa	Valor de mercado	% del patrimonio neto en la divisa base de la cartera de inversión cruzada
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	USD	3.437.705	0,85
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	USD	133.374	0,12
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	USD	858.648	0,72



## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 18 INVERSIÓN CRUZADA EN CARTERAS

(continuación)

A 30 de septiembre de 2021, Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income Portfolio invierte en acciones de las siguientes Carteras:

Cartera de inversión cruzada	Divisa	Valor de mercado	% del patrimonio neto en la divisa base de la cartera de inversión cruzada
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	USD	2.493.980	5,19
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	USD	4.161.714	3,85

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 2021:

Carteras	Contraparte	Divisa	Depósitos a plazo (en la divisa base de la cartera)
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	BNP Paribas Paris	EUR	893.648
	<b>Total</b>	<b>EUR</b>	<b>893.648</b>
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	Mitsubishi UFJ Securities	USD	1.750.005
	Rabobank Nederland Utrecht	USD	1.750.005
	<b>Total</b>	<b>USD</b>	<b>3.500.010</b>
Threadneedle (Lux) - American Select	Mitsubishi UFJ Securities	USD	9.500.024
	<b>Total</b>	<b>USD</b>	<b>9.500.024</b>
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	National Bank of Abu Dhabi	USD	1.000.679
	Sumitomo Bank Ltd London	USD	750.088
	<b>Total</b>	<b>USD</b>	<b>1.750.767</b>
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Mitsubishi UFJ Securities	EUR	22.977.278
	Sumitomo Bank Ltd London	EUR	22.985.230
	<b>Total</b>	<b>EUR</b>	<b>45.962.508</b>
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	Mitsubishi UFJ Securities	USD	7.750.190
	Rabobank Nederland Utrecht	USD	8.500.237
	<b>Total</b>	<b>USD</b>	<b>16.250.427</b>

### 20 OTROS ACTIVOS/PASIVOS

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

### 21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

El Índice de gastos totales se calcula siguiendo la guía de la Swiss Funds & Asset Management Association (SFAMA).

La fórmula aplicada es la siguiente:

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

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

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

## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Los Índices de gastos totales para el periodo finalizado el 30 de septiembre de 2021 son los siguientes:

Cartera	Clase	IGT/IGT <sup>1</sup>	
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	AEC	0,85%	
	AEH	0,85%	
	AKH	0,91%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ANH	0,85%	
	AU	0,85%	
	AUP	0,85%	
	DEC	1,60%	
	DEH	1,60%	
	DU	1,60%	
	DUP	1,60%	
	IEC	0,65%	
	IEH	0,65%	
	IEP	0,65%	
	IGC	0,65%	
	IGH	0,65%	
	IKH	0,65%	
	INH	0,70%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IU	0,65%	
	IUP	0,65%	
	NEC	0,45%	
	NEH	0,45%	
	NGC	0,45%	
	NGH	0,45%	
NU	0,45%		
NUP	0,45%		
XEH	0,10%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.	
XFH	0,05%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.	
XGH	0,15%		
XU	0,06%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.	
ZEH	0,60%		
ZFH	0,65%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.	
ZGH	0,60%		
ZU	0,60%		
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	AE	1,20%	
	ANH	1,26%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IE	0,60%	
	IEP	0,60%	
	INH	0,60%	
	XE	0,06%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	XFH	0,06%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
XGH	0,05%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.	
XUH	0,07%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.	

## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT <sup>1</sup>	
<b>Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond</b> (continuación)	ZE	0,70%	
	ZFH	0,75%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	1E	1,19%	
	1G	1,19%	
	2E	0,58%	
	2G	0,58%	
	3G	0,69%	
	4E	0,08%	
	4G	0,08%	
	8E	0,62%	
	8G	0,62%	
	9G	0,65%	
<b>Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond</b>	AE	1,62%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	AKH	1,65%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ANH	1,63%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IE	0,85%	
	IEP	0,85%	
	IKH	0,96%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	INH	0,95%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	XE	0,15%	
	ZE	0,90%	
	ZEP	0,90%	
	1E	1,38%	
	1EP	1,38%	
	1G	1,38%	
	1GP	1,38%	
	1UT	1,38%	
	2E	0,82%	
	2EP	0,77%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	2FH	0,82%	
	2G	0,82%	
	2GP	0,75%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	3E	0,77%	
	3EP	0,77%	
	3FC	0,77%	
	3FH	0,77%	
	3G	0,77%	
	3GP	0,77%	
	4E	0,07%	
	4G	0,07%	
	8E	0,86%	
	8EP	0,86%	
	8FH	0,86%	
	8G	0,86%	
	8GP	0,86%	
	9E	0,73%	
	9EP	0,73%	

## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT <sup>1</sup>	
<b>Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond</b> (continuación)	9FC	0,73%	
	9FH	0,73%	
	9G	0,63%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	9GP	0,67%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
<b>Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond</b>	AE	0,90%	
	AEP	0,90%	
	AKH	0,79%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ANH	0,80%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IE	0,50%	
	IEP	0,42%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IGC	0,42%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IGH	0,41%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IKH	0,42%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	INH	0,43%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	XE	0,10%	
	XGC	0,10%	
	XGH	0,10%	
	ZE	0,55%	
<b>Threadneedle (Lux) - European Social Bond</b>	AE	0,55%	
	AEP	0,55%	
	AFH	0,48%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	AKH	0,44%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ANH	0,45%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ASC	0,55%	
	ASH	0,55%	
	AUC	0,50%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	AUH	0,50%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ID	0,40%	
	IE	0,40%	
	IEP	0,40%	
	IFH	0,40%	
	IGH	0,40%	
	IKH	0,40%	
	INH	0,40%	
	ISC	0,57%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
ISH	0,57%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.	
IUC	0,40%		
IUH	0,40%		

## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT <sup>1</sup>	
<b>Threadneedle (Lux) - European Social Bond</b> (continuación)	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%	
<b>Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond</b>	AE	1,15%	
	AEP	1,15%	
	AKH	1,26%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ANH	1,23%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	AUH	1,15%	
	DE	1,70%	
	DEP	1,70%	
	DUH	1,79%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IE	0,55%	
	INH	0,44%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds</b>	AEC	1,65%	
	AEH	1,65%	
	AKH	1,65%	
	ANH	1,65%	
	ASH	1,65%	
	AU	1,65%	
	AUP	1,65%	
	DEC	1,75%	
	DEH	1,75%	
	DU	1,75%	
	IEC	0,85%	
	IEH	0,85%	
	IU	0,85%	
	W	1,30%	
	WEH	1,30%	
	XUP	0,05%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt</b>	AEC	1,65%	
	AEH	1,65%	
	AKH	1,65%	
	ANH	1,65%	
	ASH	1,65%	
	AU	1,65%	
	AUP	1,65%	
	DEH	1,75%	
	DU	1,75%	
	IEH	0,85%	
	IU	0,94%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	SU	1,80%	

## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT <sup>1</sup>	
<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt</b> (continuación)	SUP	1,80%	
	W	1,30%	
	XUP	0,05%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZU	0,90%	
<b>Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds</b>	AEC	1,60%	
	AEH	1,60%	
	AKH	1,60%	
	ANH	1,60%	
	ASC	1,60%	
	ASH	1,60%	
	AU	1,60%	
	AUP	1,60%	
	DEH	1,75%	
	DU	1,75%	
	IE	0,85%	
	IEH	0,85%	
	XU	0,15%	
	XUP	0,15%	
	ZEH	0,90%	
	<b>Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond</b>	AEC	1,55%
AEH		1,55%	
AKH		1,55%	
ANH		1,55%	
ASH		1,55%	
AU		1,55%	
AUP		1,55%	
DEC		1,75%	
DEH		1,75%	
DU		1,75%	
IEC		0,65%	
IEH		0,65%	
IKH		0,65%	
INH		0,65%	
ISC		0,65%	
IU		0,65%	
TEH	0,65%		
XUP	0,05%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.	
ZFH	0,90%		
ZGH	0,90%		
ZU	0,90%		
<b>Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond</b>	AEH	1,15%	
	AKH	1,15%	
	AS	1,15%	
	ASC	1,15%	
	ASH	1,15%	
	AU	1,15%	
	AUP	1,15%	
	AVC	1,31%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
AVH	1,21%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.	

## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT <sup>1</sup>	
<b>Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond</b> (continuación)	DEH	1,45%	
	IEH	0,55%	
	IGH	0,55%	
	ISH	0,55%	
	IU	0,55%	
	XU	0,15%	
	ZU	0,65%	
	ZUP	0,65%	
<b>Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return</b>	AE	1,63%	El IGT suizo incluye el coste sintético de la participación de las inversiones subyacentes, que durante el periodo de referencia equivale a 8 puntos básicos anualizados.
	AEP	1,70%	El IGT suizo incluye el coste sintético de la participación de las inversiones subyacentes, que durante el periodo de referencia equivale a 8 puntos básicos anualizados.
	DE	2,38%	El IGT suizo incluye el coste sintético de la participación de las inversiones subyacentes, que durante el periodo de referencia equivale a 8 puntos básicos anualizados.
	IE	0,93%	El IGT suizo incluye el coste sintético de la participación de las inversiones subyacentes, que durante el periodo de referencia equivale a 8 puntos básicos anualizados.
	IEP	0,98%	El IGT suizo incluye el coste sintético de la participación de las inversiones subyacentes, que durante el periodo de referencia equivale a 8 puntos básicos anualizados.
	LE	0,78%	El IGT suizo incluye el coste sintético de la participación de las inversiones subyacentes, que durante el periodo de referencia equivale a 8 puntos básicos anualizados.
	LEP	0,86%	El IGT suizo incluye el coste sintético de la participación de las inversiones subyacentes, que durante el periodo de referencia equivale a 8 puntos básicos anualizados.
	ZE	1,13%	El IGT suizo incluye el coste sintético de la participación de las inversiones subyacentes, que durante el periodo de referencia equivale a 8 puntos básicos anualizados.
	ZEP	1,13%	El IGT suizo incluye el coste sintético de la participación de las inversiones subyacentes, que durante el periodo de referencia equivale a 8 puntos básicos anualizados.
<b>Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return</b>	AEC	1,65%	
	AEH	1,65%	
	AKH	1,65%	
	AU	1,65%	
	AUP	1,65%	
	DEH	2,30%	
	DU	2,30%	
	IEH	1,02%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IGH	0,95%	
	IU	0,95%	
	W	1,75%	
<b>Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income</b>	AE	1,55%	
	AEC	1,55%	
	AEH	1,55%	
	AEP	1,55%	
	AS	1,68%	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	IGT/IGT <sup>1</sup>	
<b>Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income</b>	AUM	1,55%	
<i>(continuación)</i>	AUP	1,55%	
	DEC	2,30%	
	DEH	2,30%	
	DEP	2,30%	
	DU	2,30%	
	DUP	2,30%	
	ZE	1,05%	
	ZEC	1,05%	
	ZEH	1,05%	
	ZFH	1,05%	
	ZU	1,05%	
	ZUP	1,05%	
<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities</b>	AE	1,80%	
	AEC	1,75%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	AEH	1,80%	
	AU	1,80%	
	AUP	1,80%	
	IE	0,86%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IEH	0,86%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IG	0,80%	
	IU	0,80%	
	LE	0,50%	
	LG	0,55%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	XU	0,20%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZE	1,05%	
	ZEC	1,00%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZEH	1,00%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZU	1,05%	
	ZUP	1,05%	
<b>Threadneedle (Lux) - Global Focus</b>	AEH	1,80%	
	AEP	1,80%	
	AU	1,80%	
	AUP	1,80%	
	DEH	2,55%	
	DU	2,55%	
	IE	0,95%	
	IEH	0,95%	
	IU	0,95%	
	IUP	0,95%	
	W	1,75%	
	XU	0,15%	
	ZE	1,05%	
	ZEH	1,05%	
	ZEP	1,05%	
	ZFH	1,05%	
	ZG	1,05%	
	ZU	1,05%	



## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT <sup>1</sup>	
<b>Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities</b>	AEH	1,80%	
	AU	1,80%	
	DEH	2,55%	
	DU	2,55%	
	IE	0,95%	
	IEH	0,95%	
	IU	0,95%	
	ZU	1,10%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la significativa variación del VL medio.
	1E	1,71%	
	1U	1,71%	
	2E	1,10%	
	2U	1,10%	
	8E	1,14%	
	8U	1,14%	
<b>Threadneedle (Lux) - Global Equity Income</b>	AEC	1,80%	
	AUP	1,80%	
	DEC	2,30%	
	DUP	2,30%	
	IU	1,02%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	TE	1,14%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZU	1,05%	
	1E	1,68%	
	1EP	1,68%	
	1SC	1,68%	
	1SH	1,68%	
	1ST	1,68%	
	1U	1,68%	
	1UP	1,68%	
	1VT	1,68%	
	2E	1,07%	
	2EP	1,07%	
	2U	1,07%	
	2UP	1,07%	
	3E	0,93%	
	3EP	0,93%	
3U	0,93%		
3UP	0,93%		
8E	1,11%		
8EP	1,11%		
8U	1,11%		
8UP	1,11%		
9E	0,89%		
9EP	0,89%		
9U	0,89%		
9UP	0,79%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.	
<b>Threadneedle (Lux) - Global Select</b>	IU	0,95%	
	ZU	1,05%	
	1E	1,68%	
	1U	1,68%	
	2E	1,07%	

## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT <sup>1</sup>	
<b>Threadneedle (Lux) - Global Select</b>	2U	1,07%	
(continuación)	3U	0,90%	
	8E	1,11%	
	8U	1,11%	
	9U	0,86%	
<b>Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies</b>	AE	1,80%	
	AEP	1,80%	
	AK	1,80%	
	AUP	1,80%	
	DE	2,30%	
	IE	0,95%	
	IEP	0,95%	
	NE	0,75%	
	XE	0,15%	
	XFH	0,15%	
	XG	0,15%	
	XGH	0,15%	
	XU	0,15%	
	ZE	1,05%	
	ZFH	1,05%	
	ZG	1,05%	
	ZGH	1,05%	
	ZU	1,05%	
<b>Threadneedle (Lux) - American</b>	AEH	1,80%	
	AU	1,80%	
	DEH	2,15%	
	DU	2,15%	
	IEH	0,90%	
	IU	0,90%	
	W	1,50%	
	ZE	1,00%	
	ZEH	1,00%	
	ZU	1,00%	
	1E	1,67%	
	1EH	1,67%	
	1EP	1,67%	
	1U	1,67%	
	2E	1,06%	
	2U	1,06%	
	3EH	0,88%	
	3U	0,88%	
	8E	1,10%	
	8U	1,10%	
	9EH	0,79%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	9U	0,84%	
<b>Threadneedle (Lux) - American Select</b>	AD	1,80%	
	AEH	1,80%	
	AN	1,80%	
	AU	1,80%	
	DEH	2,55%	
	DU	2,55%	
	ID	1,00%	
	IE	1,00%	

## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT <sup>1</sup>	
<b>Threadneedle (Lux) - American Select</b>	IEH	1,00%	
(continuación)	IN	1,00%	
	W	1,75%	
	ZEH	1,10%	
	ZU	1,10%	
	1E	1,67%	
	1EH	1,67%	
	1EP	1,67%	
	1U	1,67%	
	2EH	1,06%	
	2U	1,06%	
	3E	0,87%	
	3U	0,87%	
	8EH	1,10%	
	8U	1,10%	
	9E	0,83%	
	9U	0,83%	
<b>Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies</b>	AEH	1,80%	
	AU	1,80%	
	DEH	2,30%	
	DU	2,30%	
	IE	0,95%	
	IU	0,95%	
	ZU	1,05%	
	1E	1,68%	
	1EP	1,68%	
	1U	1,68%	
	2U	1,07%	
	3EH	0,93%	
	3U	0,93%	
	8U	1,11%	
	9EH	0,89%	
	9U	0,89%	
<b>Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity</b>	AE	1,80%	
	AF	1,80%	
	AS	1,80%	
	ASH	1,80%	
	AU	1,80%	
	DE	2,55%	
	IF	0,95%	
	ISH	0,95%	
	IU	0,95%	
	XU	0,15%	
	XUP	0,15%	
	ZE	1,05%	
	ZEH	1,05%	
	ZF	1,05%	
	ZG	1,05%	
	ZU	1,05%	
<b>Threadneedle (Lux) - Asia Equities</b>	AE	1,80%	
	AEH	1,88%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase y a su reciente lanzamiento.
	DE	2,30%	

## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT <sup>1</sup>	
<b>Threadneedle (Lux) - Asia Equities</b>	DEH	2,30%	
(continuación)	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%	
<b>Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities</b>	AEC	1,85%	
	AEH	1,85%	
	AU	1,85%	
	AUP	1,85%	
	DU	2,35%	
	IU	1,05%	
	XS	0,15%	
	XSH	0,15%	
	ZEH	1,10%	
	ZFH	1,10%	
	ZGH	1,10%	
	ZU	1,10%	
<b>Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities</b>	AE	0,70%	
	AEH	0,70%	
	AU	0,70%	
	AUP	0,70%	
	DE	0,90%	
	DEH	0,90%	
	DU	0,90%	
	IE	0,35%	
	IEC	0,35%	
	IEH	0,35%	
	IFH	0,35%	
	IG	0,35%	
	IU	0,35%	
	NE	0,10%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	NG	0,20%	
	NU	0,20%	
	XG	0,10%	
	ZEH	0,45%	
	ZFH	0,45%	
	ZU	0,45%	
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities</b>	AE	1,55%	
	ASH	1,55%	
	AUH	1,55%	
	DE	1,75%	
	IE	0,80%	
	W	1,75%	
	XE	0,15%	

## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT <sup>1</sup>	
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities</b> (continuación)	ZE	1,14%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase y a su reciente lanzamiento.
	ZUH	1,00%	
	1E	1,53%	
	1EP	1,53%	
	1G	1,53%	
	1GP	1,53%	
	2E	1,08%	
	2G	1,08%	
	2U	1,08%	
	3E	0,94%	
	3G	0,94%	
	3GP	0,94%	
	4E	0,08%	
	4G	0,08%	
	8E	1,12%	
	8G	1,12%	
	8U	1,04%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	9E	0,90%	
	9G	0,90%	
	9GP	0,96%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend</b>	AE	1,80%	
	AEP	1,80%	
	AUP	1,80%	
	DE	2,15%	
	DEP	2,15%	
	IE	0,91%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la reducción de las comisiones aplicadas a esta clase de acciones el 1 de septiembre de 2021.
	IEP	0,82%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la reducción de las comisiones aplicadas a esta clase de acciones el 1 de septiembre de 2021 y a la significativa variación del VL medio.
	ZE	1,05%	
	ZEP	1,05%	
	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	1,03%	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%		

## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT <sup>1</sup>	
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend</b>	9EP	0,91%	
<i>(continuación)</i>			
	9G	0,96%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	9GP	0,96%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities</b>	AE	1,85%	
	ASH	1,85%	
	AUH	1,85%	
	DE	2,75%	
	DUH	2,75%	
	IE	1,10%	
	W	1,90%	
	ZE	1,10%	
	ZFH	1,10%	
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies</b>	IE	0,95%	
	ZE	1,10%	
	1E	1,72%	
	1EP	1,72%	
	1FH	1,72%	
	1G	1,72%	
	1UH	1,72%	
	2E	1,07%	
	2G	1,07%	
	3E	0,91%	
	3EP	0,91%	
	3FH	0,91%	
	3G	0,91%	
	3GP	0,91%	
	3UH	0,91%	
	4E	0,07%	
	4G	0,07%	
	8E	1,11%	
	8G	1,11%	
	9E	0,87%	
	9EP	0,82%	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	0,82%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	9UH	0,87%	
<b>Threadneedle (Lux) - European Select</b>	AE	1,80%	
	AGH	1,80%	
	AUH	1,80%	
	DUH	2,35%	
	IE	0,95%	
	ZG	1,05%	
	ZGH	1,05%	
	1E	1,65%	
	1EP	1,65%	
	1SH	1,65%	
	1U	1,65%	
	1UH	1,65%	
	2E	1,06%	

## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT <sup>1</sup>	
<b>Threadneedle (Lux) - European Select</b> (continuación)	2EP	1,01%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la significativa variación del VL medio.
	3E	0,88%	
	3U	0,88%	
	8E	1,10%	
	8EP	1,10%	
	9E	0,84%	
	9U	0,84%	
<b>Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies</b>	IE	0,95%	
	ZE	1,10%	
	1E	1,72%	
	1EP	1,72%	
	1FH	1,72%	
	2E	1,07%	
	3E	0,93%	
	3EP	0,93%	
	3FH	0,93%	
	8E	1,11%	
	9E	0,89%	
	9EP	0,89%	
	9FH	0,89%	
<b>Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income</b>	AEH	1,80%	
	AU	1,80%	
	AUP	1,80%	
	DEH	2,55%	
	DU	2,55%	
	DUP	2,55%	
	IEP	0,95%	
	IU	1,00%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	W	2,00%	
	XU	0,15%	
	XUP	0,15%	
	ZG	1,05%	
	ZGH	1,05%	
	ZGP	1,05%	
	ZUP	1,05%	
<b>Threadneedle (Lux) - Global Technology</b>	AEH	1,95%	
	AS	1,95%	
	AU	1,95%	
	AUP	1,95%	
	BU	2,35%	
	DEH	2,30%	
	DU	2,30%	
	IE	1,05%	
	IEH	1,05%	
	IG	1,05%	
	IU	1,05%	
	ZEH	1,15%	
	ZFH	1,15%	
	ZG	1,15%	
	ZU	1,15%	

## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT <sup>1</sup>	
<b>Threadneedle (Lux) - UK Equities</b>	AE	1,80%	
	AEH	1,80%	
	AFH	1,80%	
	AG	1,80%	
	AGP	1,75%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la significativa variación del VL medio.
	DEH	2,60%	
	DG	2,60%	
	IE	0,85%	
	IEH	0,85%	
	IG	0,85%	
	IGP	0,85%	
	NEH	0,68%	
	NFH	0,68%	
	NG	0,63%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	NGP	0,63%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	NUH	0,63%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	TEH	0,72%	
	TFH	0,72%	
	TG	0,64%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	TGP	0,64%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	TUH	0,64%	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%		
<b>Threadneedle (Lux) - UK Equity Income</b>	AE	1,80%	
	AEC	1,80%	
	AEH	1,80%	
	AG	1,80%	
	ASC	1,80%	
	AUC	1,80%	
	DE	2,55%	
	DEC	2,63%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
DEH	2,55%		
DG	2,55%		



## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT <sup>1</sup>	
<b>Threadneedle (Lux) - UK Equity Income</b> (continuación)	DGP	2,62%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IE	0,85%	
	IEH	0,85%	
	IG	0,85%	
	IGP	0,85%	
	IU	0,85%	
	IUH	0,72%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	LG	0,70%	
	LGP	0,70%	
	ZE	1,05%	
	ZEH	1,05%	
	ZFH	1,05%	
	ZG	1,05%	
	ZGP	1,05%	
	ZUH	1,05%	
	1EH	1,64%	
	1FH	1,64%	
	1UH	1,64%	
	3EH	0,88%	
	3FH	0,88%	
3UH	0,88%		
9EH	0,84%		
9FH	0,84%		
9G	0,84%		
9UH	0,84%		
<b>Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity*</b>	IU	1,43%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la interrupción de las comisiones de gestión de activos aplicadas a esta clase de acciones el 18 de junio de 2021 y a la significativa variación del VL medio.
	ZU	1,42%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la interrupción de las comisiones de gestión de activos aplicadas a esta clase de acciones el 18 de junio de 2021 y a la significativa variación del VL medio.
<b>Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha</b>	AEH	1,80%	
	AFH	1,80%	
	AGH	1,80%	
	AU	1,80%	
	DEH	2,30%	
	DU	2,30%	
	IEH	0,95%	
	IGH	0,95%/1,25%	
	IU	0,95%/1,21%	
	XGH	0,15%	
	ZE	1,05%	
	ZEH	1,05%	
	ZGH	1,05%	
ZU	1,05%/1,39%		
<b>Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities</b>	AE	0,98%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase y a su reciente lanzamiento.
	IE	0,49%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase y a su reciente lanzamiento.
	ZE	0,78%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido a la reducción de las comisiones aplicadas a esta clase de acciones el 1 de septiembre de 2021.

## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT <sup>1</sup>	
<b>Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities</b> (continuación)	1E	1,17%	
	1EP	1,17%	
	1GH	1,17%	
	1UH	1,17%	
	2E	0,56%	
	2EP	0,45%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	2GC	0,56%	
	2GH	0,56%	
	4GH	0,06%	
	8E	0,60%	
	8EP	0,60%	
	8GC	0,60%	
	8GH	0,60%	
<b>Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities</b>	AE	1,20%	
	AFH	1,13%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	AKH	1,20%	
	ANH	1,20%	
	AUH	1,20%	
	DE	1,75%	
	IE	0,55%	
	IEP	0,66%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IGH	0,55%	
	INH	0,64%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IU	0,64%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	IUH	0,62%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	JE	0,57%/0,65%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	JGH	0,45%/0,58%	
	JUH	0,54%/0,70%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	LE	0,40%	
	LEP	0,40%	
	LGH	0,40%	
	XE	0,15%	
	XGH	0,15%	
	XUH	0,15%	
	YE	0,67%/0,74%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	YGH	0,60%/0,75%	
	YUH	0,73%/0,87%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZE	0,70%	
	ZFH	0,70%	
	ZGH	0,70%	
	ZUH	0,75%	El IGT actual difiere del IGT esperado para el ejercicio completo debido al tamaño pequeño de la clase.
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha</b>	AE	1,85%/1,74%	
	AEP	1,85%/1,70%	

## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 21 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT <sup>1</sup>
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha</b> (continuación)	AUH	1,85%/2,00%
	DE	2,35%/1,89%
	IE	0,95%/0,88%
	IGH	0,95%/-0,80%
	LE	0,575%/0,44%
	XGH	0,15%
	ZE	1,05%/0,58%
	ZF	1,05%/0,73%
	ZFH	1,05%/1,14%
	ZGH	1,05%/0,12%
<b>Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha</b>	AEH	1,80%
	AU	1,80%
	DEH	2,30%
	DU	2,30%
	IU	0,90%
	ZU	1,05%
	1E	1,69%
	1EH	1,69%
	1U	1,69%
	2E	0,83%
	2U	0,83%
	3U	0,94%
	8E	0,87%
	8U	0,87%
	9U	0,90%
<b>Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha</b>	AEH	1,80%
	AU	1,80%
	DEH	2,30%
	DU	2,30%
	IU	0,90%
	ZU	1,05%
	1E	1,69%
	1U	1,69%
	2E	0,83%
	2U	0,83%
	8E	0,87%
	8U	0,87%
<b>Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities</b>	AEH	2,05%
	AFH	2,05%
	AGH	2,05%
	ASH	2,05%
	AU	2,05%
	DEH	2,55%
	DU	2,55%
	IEH	1,00%
	IG	1,00%
	IGH	1,00%
	IU	1,00%
	NG	0,65%
	XU	0,15%
	ZEH	1,05%
	ZFH	1,05%
	ZGH	1,05%
	ZU	1,05%

<sup>1</sup> El IGT incluye la comisión de rendimiento.

\* Consulte la nota 1.

## Notas a los estados financieros

(continuación)

### 22 EVENTOS SUBSECUENTES

A partir del 1 de diciembre de 2021, se ha procedido a reducir las comisiones de las siguientes clases de Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities Portfolio como sigue:

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

\* sin cambios

### 23 INFORMACIÓN ADICIONAL

La crisis sanitaria propiciada por la enfermedad por coronavirus 2019 (COVID-19) ha derivado en una pandemia que ha ocasionado —y posiblemente continúe ocasionando— importantes perturbaciones económicas y sociales a nivel mundial, así como la volatilidad del mercado debido a interrupciones en el acceso al mercado, la disponibilidad de recursos, la gestión operativa de instalaciones, la imposición de aranceles, los controles a la exportación y la interrupción en la cadena de suministro, entre otros factores. La imposición de cuarentenas y restricciones en los viajes y desplazamientos, las reestructuraciones laborales y la pérdida de recursos humanos y de otra índole pueden provocar y agravar estas interrupciones. La incertidumbre en torno a la magnitud, la duración, el alcance, el coste y los efectos de la pandemia mundial, así como las acciones que las autoridades gubernamentales u otros organismos han emprendido o podrían emprender, presentan una serie de incógnitas que aún no se han desvelado. Las repercusiones, así como la inquietud en torno a las repercusiones futuras de la COVID-19 —y de cualquier otro brote, epidemia y pandemia de enfermedades infecciosas que puedan surgir en adelante—, podrían perjudicar a las economías y los mercados mundiales de formas imprevisibles. Además, el impacto de los brotes y epidemias de enfermedades infecciosas en los países de mercados emergentes puede ser de mayor envergadura, dado que sus sistemas sanitarios, sus gobiernos y sus mercados financieros presentan, por lo general, un menor arraigo. Las crisis sanitarias debidas al brote de COVID-19 pueden agravar otros riesgos políticos, sociales y económicos preexistentes en determinados países o a nivel mundial. Las perturbaciones causadas por la COVID-19 podrían impedir que los fondos lleven a cabo decisiones de inversión favorables de forma oportuna y podrían repercutir negativamente en la capacidad de los fondos para alcanzar sus objetivos de inversión. Cualquiera de estos supuestos podría tener un efecto adverso significativo en el valor y en el perfil de riesgo de los fondos.

## 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 de 10 de agosto de 1915, en su versión modificada, y califica como un Organismo de inversión colectiva en valores mobiliarios («OICVM») en virtud de la Parte I de la Ley del 17 de diciembre de 2010, en su versión modificada.

La SICAV se constituyó el 10 de febrero de 1995 por un periodo ilimitado. Los estatutos de la SICAV se publicaron por primera vez en el *Recueil des Sociétés et Associations* (registro mercantil) del Gran Ducado de Luxemburgo el 31 de marzo de 1995 y se modificaron por última vez a partir del 14 de septiembre de 2018.

La SICAV está registrada en el Registro Mercantil de Luxemburgo con el número B-50216.

La junta general anual de Accionistas de la SICAV se celebrará en Luxemburgo, según se especifique en la convocatoria, dentro de los seis meses siguientes al cierre del ejercicio contable. La junta general anual podrá celebrarse en el extranjero si, a juicio absoluto y definitivo del Consejo, las circunstancias excepcionales así lo requieren. Las demás juntas de Accionistas podrán celebrarse en el lugar y plazo de la convocatoria que se especifique en las respectivas convocatorias. Las convocatorias de las juntas generales se realizan de acuerdo con la legislación luxemburguesa y de acuerdo con las normas aplicables en los países pertinentes en los que las Acciones se ofrecen públicamente a la venta. En las convocatorias se especificarán el lugar y la hora de la junta, las condiciones de admisión, el orden del día, el quórum y los requisitos de votación.

El ejercicio contable de la SICAV finaliza el 31 de marzo de cada año.

El informe anual y los estados financieros auditados y el informe semestral no auditado están disponibles en el domicilio social de la SICAV y en la oficina principal de cada agente de pagos y distribuidor. Las cuentas combinadas de la SICAV se expresan en dólares estadounidenses.

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

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

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

### **Documento de datos fundamentales para el inversor («KIID»): requisitos de suscripción**

El KIID es un documento precontractual y los inversores deberán confirmar que han leído el último KIID antes de hacer una suscripción. La Sociedad Gestora tiene el derecho de rechazar una suscripción si el inversor no confirma que ha leído el último KIID en el momento de la solicitud. El último KIID se podrá obtener en [www.columbiathreadneedle.com](http://www.columbiathreadneedle.com).

## **Información para inversores en Suiza**

El informe anual y los estados financieros auditados, el informe semestral no auditado, el informe sobre los cambios en las participaciones de la Cartera correspondiente al ejercicio, los estatutos, el Folleto (versión suiza) y el KIID podrán obtenerse previa solicitud y sin coste alguno en las oficinas del Representante y agente de pagos suizo de la SICAV, RBC Investor Services Bank S.A., Esch-sur-Alzette, Sucursal de Zúrich, Bleicherweg 7, 8027 Zúrich, Suiza, o en el domicilio social de la SICAV.

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

## Reglamento de operaciones de financiación de valores

El Reglamento (UE) 2015/2365 del Parlamento Europeo y del Consejo sobre transparencia de las operaciones de financiación de valores y de reutilización («SFTR», por sus siglas en inglés) presenta los requisitos de información de operaciones de financiación de valores («SFT», por sus siglas en inglés) y de swaps de rentabilidad total. Una SFT viene definida en el artículo 3(11) del SFTR como:

- un acuerdo de recompra/recompra inversa;
- préstamos de valores o materias primas y empréstitos de valores o materias primas;
- una operación de compra con pacto de reventa o una operación de venta con pacto de recompra; o
- una operación de préstamo de márgenes.

A 30 de septiembre de 2021, la SICAV realizó swaps de rentabilidad total («SRT») como tipo de instrumentos en el alcance del SFTR.

### Datos globales

Nombre de la Cartera	Tipo de activo	Ganancias y pérdidas no realizadas en la divisa base de la cartera y en valor absoluto	% del patrimonio neto
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	SRT	52.524	0,23
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	SRT	1.521.509	1,04
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	SRT	1.371.764	1,20
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	SRT	2.279.585	2,12
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	SRT	4.733.590	1,18

### Datos de reutilización de garantías

No hubo reutilización de garantías durante el periodo finalizado el 30 de septiembre de 2021.

### Datos de concentración

Todas las garantías recibidas con respecto a SRT a 30 de septiembre de 2021 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 2021:

Nombre de la Cartera	Tipo de activo	Contraparte	Ganancias y pérdidas no realizadas en la divisa base de la cartera y en valor absoluto
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	SRT	Bank of America Merrill Lynch	43.450
		UBS	9.074
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	SRT	UBS	1.471.553
		Goldman Sachs	49.956
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	SRT	Bank of America Merrill Lynch	1.345.932
		UBS	25.832
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	SRT	UBS	2.279.585
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	SRT	Macquarie	1.552.777
		JPMorgan	1.533.050
		Goldman Sachs	957.553
		Citigroup Global Markets	354.846
		Credit Suisse	335.364

### Custodia de 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 2021:

Nombre de la Cartera	Tipo de garantía	Contraparte	Divisa de garantía	Importe de garantía
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	Efectivo	UBS	EUR	3.860.000
		Goldman Sachs	EUR	740.000
		<b>Total</b>	<b>EUR</b>	<b>4.600.000</b>

### Datos generales de operaciones

Nombre de la Cartera	Tipo de garantía	Plazo de vencimiento (garantía)	Divisa de garantía	Plazo de vencimiento (SFT/SRT)	País de establecimiento (contraparte)	Liquidación y compensación	Calidad de la garantía
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	Efectivo	Vencimiento abierto	USD	de 3 meses a 1 año	Reino Unido	Bilateral	N/D – Efectivo
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	Efectivo	Vencimiento abierto	EUR	de 3 meses a 1 año / más de 1 año	Reino Unido	Bilateral	N/D – Efectivo
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Efectivo	Vencimiento abierto	USD	de 3 meses a 1 año / más de 1 año	Reino Unido	Bilateral	N/D – Efectivo
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	Efectivo	Vencimiento abierto	USD	de 3 meses a 1 año / más de 1 año	Reino Unido	Bilateral	N/D – Efectivo
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Efectivo	Vencimiento abierto	USD	menos de 1 día / 1 día	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 2021 es el siguiente:

Nombre de la Cartera	Tipo de garantía	Contraparte	Divisa de garantía	Importe de garantía	% de garantía mantenida al cierre del periodo por categoría
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	Efectivo	UBS	USD	160.000	0,70
		Bank of America Merrill Lynch	USD	10.000	0,04
		<b>Total</b>	<b>USD</b>	<b>170.000</b>	<b>0,74</b>
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Efectivo	Bank of America Merrill Lynch	USD	1.089.000	0,95
		UBS	USD	270.000	0,24
		<b>Total</b>	<b>USD</b>	<b>1.359.000</b>	<b>1,19</b>
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	Efectivo	UBS	USD	2.860.000	2,66
		<b>Total</b>	<b>USD</b>	<b>2.860.000</b>	<b>2,66</b>
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Efectivo	JPMorgan	USD	2.780.000*	0,69
		Macquarie	USD	1.740.000	0,43
		<b>Total</b>	<b>USD</b>	<b>4.520.000</b>	<b>1,12</b>

### Rendimiento/Costes

El rendimiento y los costes operativos de SRT a 30 de septiembre de 2021 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 a<sup>1</sup>:

Columbia Management  
Investment Advisers, LLC  
225 Franklin Street  
Boston MA 02110  
Estados Unidos de América

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

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

STANLIB Asset Management (Pty) Limited Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity<sup>7</sup>  
17 Melrose Boulevard  
Melrose Arch 2196  
Johannesburgo  
Sudáfrica

### Sociedad Gestora

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

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond  
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities<sup>2</sup>  
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities<sup>2</sup>  
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities  
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities  
Threadneedle (Lux) - Global Technology  
  
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond<sup>3</sup>  
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 Bonds<sup>3</sup>  
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt<sup>3</sup>  
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds<sup>3</sup>  
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond<sup>4</sup>  
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return  
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return  
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income<sup>5</sup>  
Threadneedle (Lux) - Global Focus  
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income  
Threadneedle (Lux) - Global Select  
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies  
Threadneedle (Lux) - American<sup>5</sup>  
Threadneedle (Lux) - American Select<sup>5</sup>  
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies<sup>5</sup>  
Threadneedle (Lux) - Asia Equities<sup>4</sup>  
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities<sup>5</sup>  
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 Income<sup>4</sup>  
Threadneedle (Lux) - UK Equities  
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income  
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha<sup>5</sup>  
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities  
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities  
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha  
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha  
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha  
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity<sup>6</sup>

<sup>1</sup> Sujeto a la responsabilidad y supervisión de Threadneedle Management Luxembourg S.A.

<sup>2</sup> 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.

<sup>3</sup> Threadneedle Asset Management Limited podrá, sujeto a su propia responsabilidad, delegar la gestión de inversiones discretionales de parte de los activos de la Cartera a Columbia Management Investment Advisers, LLC.

<sup>4</sup> Threadneedle Asset Management Limited podrá, sujeto a su propia responsabilidad, delegar la gestión de inversiones discretionales de parte de los activos de la Cartera a Threadneedle Investments Singapore (Pte.) Limited.

<sup>5</sup> 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.

<sup>6</sup> 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.

<sup>7</sup> Consulte la nota 1, página 230.

## Directorio

(continuación)

### **Depositario, Agente domiciliario, administrativo y de pagos**

Citibank Europe plc, Sucursal de Luxemburgo  
31, Z.A. Bourmicht  
L-8070 Bertrange  
Gran Ducado de Luxemburgo

### **Secretario y Agente de transferencia**

International Financial Data Services (Luxembourg) S.A.  
47, Avenue John F. Kennedy  
L-1855 Luxemburgo  
Gran Ducado de Luxemburgo

### **Distribuidor (delegado a una variedad de distribuidores)**

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

### **Representantes y agentes de pago**

#### **En Austria**

Erste Bank der oesterreichischen Sparkassen AG  
Graben 21  
A-1010 Viena  
Austria

#### **En Bélgica**

CACEIS Belgium S.A.  
Avenue du Port 86 C b 320  
B-1000 Bruselas  
Bélgica

#### **En Francia**

CACEIS Bank France  
1/3 Place Valhubert  
F-75206 Paris Cedex 13  
Francia

#### **En Alemania**

J.P. Morgan AG  
Junghofstrasse 14  
D-60311 Fráncfort del Meno  
Alemania

#### **En Hong Kong**

HSBC Institutional Trust Services (Asia) Limited  
17/F Tower 2 & 3 HSBC Centre  
1 Sham Mong Road  
Kowloon  
Hong Kong

#### **En Suiza**

RBC Investor Services Bank S.A., Esch-sur-Alzette  
Sucursal de Zúrich  
Bleicherweg 7  
CH-8027 Zúrich  
Suiza

#### **Auditor**

PricewaterhouseCoopers, *Société coopérative*  
2, rue Gerhard Mercator, B.P. 1443  
L-1014 Luxemburgo  
Gran Ducado de Luxemburgo

#### **Asesores legales en Luxemburgo**

Linklaters LLP, Luxemburgo  
35 Avenue John F. Kennedy, B.P. 1107  
L-1011 Luxemburgo  
Gran Ducado de Luxemburgo

Para obtener más información, visite [columbiathreadneedle.com](http://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 el 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](http://columbiathreadneedle.com) 415021