

**Núm. registre CNMV:** 93  
**Data de registre:** 09/02/1988  
**Gestora:** CAIXABANK ASSET MANAGEMENT SGIIC, S.A.  
**Dipositari:** CECABANK, S.A.  
**Grup Gestora/Dipositari:** CAIXABANK, SA / CECABANK, S.A.  
**Ràting Dipositari:** BBB+  
**Auditor:** PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDITORES SL

Aquest informe, juntament amb els últims informes periòdics, estan disponibles per mitjans telemàtics a [www.caixabank.es](http://www.caixabank.es) o [www.caixabankassetmanagement.com](http://www.caixabankassetmanagement.com)

L'entitat gestora atén les consultes dels clients, relacionades amb les IIC gestionades a Passeig de la Castellana, 51, 5a planta, 28046 Madrid., correu electrònic Per mitjà del formulari disponible a [www.caixabank.es](http://www.caixabank.es)

A més disposa d'un departament o servei d'atenció al client encarregat de resoldre les queixes i reclamacions. Igualment, la CNMV posa a la seva disposició l'Oficina d'Atenció a l'Inversor (902 149 200, correu electrònic: [inversores@cnmv.es](mailto:inversores@cnmv.es)).

## 1. POLÍTICA D'INVERSIÓ I DIVISA DE DENOMINACIÓ

**CATEGORIA:** Tipus de fons: D'altres; Vocació inversora: Renda fixa euro; Perfil de risc: 2 - Baix

**DESCRIPCIÓ GENERAL:** El fons inverteix el patrimoni en actius de renda fixa, tant pública com privada. Les emissions en què inverteixi podran presentar exposició a risc de crèdit de qualitat creditícia inferior a la mitjana (inferior a BBB-). La durada mitjana de la cartera del fons serà inferior a 3 anys.

**OPERACIONS EN INSTRUMENTS DERIVATS:** El fons ha fet operacions amb instruments derivats, amb la finalitat d'inversió per gestionar d'una manera més eficaç la cartera. La metodologia aplicada per a calcular l'exposició total al risc de mercat és Mètode del compromís.

Una informació més detallada sobre la política d'inversió del fons es pot trobar en el seu fulllet informatiu.

**DIVISA DE DENOMINACIÓ:** Euro

## 2. DADES ECONÒMIQUES

### 2.1. DADES GENERALS

|   | Període actual | Període anterior | Any actual | Any anterior |
|---|----------------|------------------|------------|--------------|
| Índex de rotació de la cartera                      | 0,22           | 0,72             | 0,89       | 1,35         |
| Rendibilitat mitjana de la liquiditat(% anualitzat) | -0,37          | -0,12            | -0,25      | -0,38        |

Nota: El període es refereix al trimestre o semestre, segons el cas. En el cas d'IIC el valor liquidatiu no es determina diàriament, les dades es refereixen a l'últim disponible.

#### CAIXABANK AHORRO, FI CLASE ESTANDAR

|   | Període actual | Període anterior | Data    | Patrimoni (milers de euros) | Valor liquidatiu (euros) | Comissions aplicades en el període, sobre patrimoni mitjà |           | % cobrat efectivament |           | Base de càlcul |
|---|----------------|------------------|---------|-----------------------------|--------------------------|---|-----------|-----------------------|-----------|----------------|
|   |                |                  |         |                             |                          | Període   | Acumulada | Període               | Acumulada |                |
| Nre. de participacions                      | 6.743.251,68   | 7.230.107,47     | Període | 203.606                     | 30,1941                  | Comissió de gestió  | 0,23      | 0,45                  | Patrimoni |                |
| Nº de participis                            | 10.543         | 11.405           | 2020    | 244.895                     | 30,3868                  | Comissió de resultats                                     | 0,00      | 0,00                  | Resultats |                |
| Benef. bruts distrib. per particip. (Euros) | 0,00           | 0,00             | 2019    | 307.663                     | 30,3624                  | Comissió de gestió total                                  | 0,23      | 0,45                  | Mixta     |                |
|   |                |                  | 2018    | 379.043                     | 30,2235                  | Comissió de dipositari                                    | 0,03      | 0,05                  | Patrimoni |                |
| Inversió mínima: 600,00 (Euros)             |                |                  |         |                             |                          |   |           |                       |           |                |

#### CAIXABANK AHORRO, FI CLASE PLUS

|   | Període actual | Període anterior | Data    | Patrimoni (milers de euros) | Valor liquidatiu (euros) | Comissions aplicades en el període, sobre patrimoni mitjà |           | % cobrat efectivament |           | Base de càlcul |
|---|----------------|------------------|---------|-----------------------------|--------------------------|---|-----------|-----------------------|-----------|----------------|
|   |                |                  |         |                             |                          | Període   | Acumulada | Període               | Acumulada |                |
| Nre. de participacions                      | 3.924.611,18   | 4.575.109,60     | Període | 119.268                     | 30,3897                  | Comissió de gestió  | 0,23      | 0,45                  | Patrimoni |                |
| Nº de participis                            | 1.634          | 1.880            | 2020    | 171.616                     | 30,5836                  | Comissió de resultats                                     | 0,00      | 0,00                  | Resultats |                |
| Benef. bruts distrib. per particip. (Euros) | 0,00           | 0,00             | 2019    | 214.708                     | 30,5591                  | Comissió de gestió total                                  | 0,23      | 0,45                  | Mixta     |                |
|   |                |                  | 2018    | 265.559                     | 30,4193                  | Comissió de dipositari                                    | 0,03      | 0,05                  | Patrimoni |                |
| Inversió mínima: 50.000,00 (Euros)          |                |                  |         |                             |                          |   |           |                       |           |                |

#### CAIXABANK AHORRO, FI CLASE PREMIUM

|   | Període actual | Període anterior | Data    | Patrimoni (milers de euros) | Valor liquidatiu (euros) | Comissions aplicades en el període, sobre patrimoni mitjà |           | % cobrat efectivament |           | Base de càlcul |
|---|----------------|------------------|---------|-----------------------------|--------------------------|---|-----------|-----------------------|-----------|----------------|
|   |                |                  |         |                             |                          | Període   | Acumulada | Període               | Acumulada |                |
| Nre. de participacions                      | 1.567.984,34   | 1.991.910,98     | Període | 48.092                      | 30,6715                  | Comissió de gestió  | 0,23      | 0,45                  | Patrimoni |                |
| Nº de participis                            | 174            | 196              | 2020    | 70.866                      | 30,8672                  | Comissió de resultats                                     | 0,00      | 0,00                  | Resultats |                |
| Benef. bruts distrib. per particip. (Euros) | 0,00           | 0,00             | 2019    | 80.562                      | 30,8425                  | Comissió de gestió total                                  | 0,23      | 0,45                  | Mixta     |                |
|   |                |                  | 2018    | 97.942                      | 30,7014                  | Comissió de dipositari                                    | 0,03      | 0,05                  | Patrimoni |                |
| Inversió mínima: 300.000,00 (Euros)         |                |                  |         |                             |                          |   |           |                       |           |                |

#### CAIXABANK AHORRO, FI C INSTITUCIONAL

|   | Període actual | Període anterior | Data    | Patrimoni (milers de euros) | Valor liquidatiu (euros) | Comissions aplicades en el període, sobre patrimoni mitjà |           | % cobrat efectivament |           | Base de càlcul |
|---|----------------|------------------|---------|-----------------------------|--------------------------|---|-----------|-----------------------|-----------|----------------|
|   |                |                  |         |                             |                          | Període   | Acumulada | Període               | Acumulada |                |
| Nre. de participacions                      | 4.187.248,67   | 8.936.131,74     | Període | 25.092                      | 5,9925                   | Comissió de gestió  | 0,14      | 0,28                  | Patrimoni |                |
| Nº de participis                            | 2              | 4                | 2020    | 45.267                      | 6,0187                   | Comissió de resultats                                     | 0,00      | 0,00                  | Resultats |                |
| Benef. bruts distrib. per particip. (Euros) | 0,00           | 0,00             | 2019    | 52.141                      | 6,0018                   | Comissió de gestió total                                  | 0,14      | 0,28                  | Mixta     |                |
|   |                |                  | 2018    | 44.844                      | 5,9625                   | Comissió de dipositari                                    | 0,01      | 0,03                  | Patrimoni |                |
| Inversió mínima: 5.000.000,00 (Euros)       |                |                  |         |                             |                          |   |           |                       |           |                |

#### CAIXABANK AHORRO, FI CLASE CARTERA

|   | Període actual | Període anterior | Data    | Patrimoni (milers de euros) | Valor liquidatiu (euros) | Comissions aplicades en el període, sobre patrimoni mitjà |           | % cobrat efectivament |           | Base de càlcul |
|---|----------------|------------------|---------|-----------------------------|--------------------------|---|-----------|-----------------------|-----------|----------------|
|   |                |                  |         |                             |                          | Període   | Acumulada | Període               | Acumulada |                |
| Nre. de participacions                      | 92.190.801,38  | 80.363.859,88    | Període | 553.864                     | 6,0078                   | Comissió de gestió  | 0,10      | 0,20                  | Patrimoni |                |
| Nº de participis                            | 2.499          | 2.078            | 2020    | 289.540                     | 6,0293                   | Comissió de resultats                                     | 0,00      | 0,00                  | Resultats |                |
| Benef. bruts distrib. per particip. (Euros) | 0,00           | 0,00             | 2019    | 145.466                     | 6,0076                   | Comissió de gestió total                                  | 0,10      | 0,20                  | Mixta     |                |
|   |                |                  | 2018    | 3.464.563                   | 5,9602                   | Comissió de dipositari                                    | 0,01      | 0,02                  | Patrimoni |                |
| Inversió mínima: 0,00 (Euros)               |                |                  |         |                             |                          |   |           |                       |           |                |

## 2.2. COMPORTAMENT

### 2.2.1. Individual - CAIXABANK AHORRO, FI. Divisa Euro

#### Rendibilitat (% anualitzat)

| CAIXABANK AHORRO, FI CLASE ESTANDAR | Acumulat any actual | Trimestral       |          |           |          | Anual         |      |      |      |
|-------------------------------------|---------------------|------------------|----------|-----------|----------|---------------|------|------|------|
|                                     |                     | 31-12-21         | 30-09-21 | 30-06-21  | 31-03-21 | 2020          | 2019 | 2018 | 2016 |
| Rentabilitat                        | -0,63               | -0,26            | -0,13    | -0,22     | -0,03    |               |      |      |      |
| <b>Rendibilitats extremes*</b>      |                     | Trimestre actual |          | Últim any |          | Últims 3 anys |      |      |      |
|                                     |                     | %                | Data     | %         | Data     | %             | Data | %    | Data |
| Rendibilitat mínima (%)             |                     | -0,11            | 29-10-21 | -0,11     | 29-10-21 |               |      |      | --   |
| Rendibilitat màxima (%)             |                     | 0,14             | 02-11-21 | 0,14      | 02-11-21 |               |      |      | --   |

| CAIXABANK AHORRO, FI CLASE PLUS | Acumulat any actual | Trimestral       |          |           |          | Anual         |      |      |      |
|---------------------------------|---------------------|------------------|----------|-----------|----------|---------------|------|------|------|
|                                 |                     | 31-12-21         | 30-09-21 | 30-06-21  | 31-03-21 | 2020          | 2019 | 2018 | 2016 |
| Rentabilitat                    | -0,63               | -0,26            | -0,13    | -0,22     | -0,02    |               |      |      |      |
| <b>Rendibilitats extremes*</b>  |                     | Trimestre actual |          | Últim any |          | Últims 3 anys |      |      |      |
|                                 |                     | %                | Data     | %         | Data     | %             | Data | %    | Data |
| Rendibilitat mínima (%)         |                     | -0,11            | 29-10-21 | -0,11     | 29-10-21 |               |      |      | --   |
| Rendibilitat màxima (%)         |                     | 0,14             | 02-11-21 | 0,14      | 02-11-21 |               |      |      | --   |

| CAIXABANK AHORRO, FI CLASE PREMIUM | Acumulat any actual | Trimestral       |          |           |          | Anual         |      |      |      |
|------------------------------------|---------------------|------------------|----------|-----------|----------|---------------|------|------|------|
|                                    |                     | 31-12-21         | 30-09-21 | 30-06-21  | 31-03-21 | 2020          | 2019 | 2018 | 2016 |
| Rentabilitat                       | -0,63               | -0,26            | -0,13    | -0,22     | -0,02    |               |      |      |      |
| <b>Rendibilitats extremes*</b>     |                     | Trimestre actual |          | Últim any |          | Últims 3 anys |      |      |      |
|                                    |                     | %                | Data     | %         | Data     | %             | Data | %    | Data |
| Rendibilitat mínima (%)            |                     | -0,11            | 29-10-21 | -0,11     | 29-10-21 |               |      |      | --   |
| Rendibilitat màxima (%)            |                     | 0,14             | 02-11-21 | 0,14      | 02-11-21 |               |      |      | --   |

| CAIXABANK AHORRO, FI C INSTITUCIONAL | Acumulat any actual | Trimestral       |          |           |          | Anual         |      |      |      |
|--------------------------------------|---------------------|------------------|----------|-----------|----------|---------------|------|------|------|
|                                      |                     | 31-12-21         | 30-09-21 | 30-06-21  | 31-03-21 | 2020          | 2019 | 2018 | 2016 |
| Rentabilitat                         | -0,44               | -0,21            | -0,08    | -0,17     | 0,02     |               |      |      |      |
| <b>Rendibilitats extremes*</b>       |                     | Trimestre actual |          | Últim any |          | Últims 3 anys |      |      |      |
|                                      |                     | %                | Data     | %         | Data     | %             | Data | %    | Data |
| Rendibilitat mínima (%)              |                     | -0,11            | 29-10-21 | -0,11     | 29-10-21 |               |      |      | --   |
| Rendibilitat màxima (%)              |                     | 0,14             | 02-11-21 | 0,14      | 02-11-21 |               |      |      | --   |

| CAIXABANK AHORRO, FI CLASE CARTERA | Acumulat any actual | Trimestral       |          |           |          | Anual         |      |      |      |
|------------------------------------|---------------------|------------------|----------|-----------|----------|---------------|------|------|------|
|                                    |                     | 31-12-21         | 30-09-21 | 30-06-21  | 31-03-21 | 2020          | 2019 | 2018 | 2016 |
| Rentabilitat                       | -0,36               | -0,19            | -0,05    | -0,16     | 0,04     |               |      |      |      |
| <b>Rendibilitats extremes*</b>     |                     | Trimestre actual |          | Últim any |          | Últims 3 anys |      |      |      |
|                                    |                     | %                | Data     | %         | Data     | %             | Data | %    | Data |
| Rendibilitat mínima (%)            |                     | -0,11            | 29-10-21 | -0,11     | 29-10-21 |               |      |      | --   |
| Rendibilitat màxima (%)            |                     | 0,14             | 02-11-21 | 0,14      | 02-11-21 |               |      |      | --   |

\* Només se n'informa per a les classes amb una antiguitat mínima del període sol·licitat i sempre que no s'hagi modificat la vocació inversora. Fa referència a les rendibilitats màximes i mínimes entre dos valors liquidatius consecutius.

La periodicitat de càlcul del valor liquidatiu és diària.

Recordi que rendibilitats passades no pressuposen rendibilitats futures. Només se n'informa si s'ha mantingut una política d'inversió homogènia en el període.

#### Mesures de risc (%)

| Volatilitat* de:   | Acumulat any actual | Trimestral |          |          |          | Anual |      |      |      |
|--|---------------------|------------|----------|----------|----------|-------|------|------|------|
|  |                     | 31-12-21   | 30-09-21 | 30-06-21 | 31-03-21 | 2020  | 2019 | 2018 | 2016 |
| Ibex-35 Net TR   | 16,23               | 18,34      | 16,09    | 14,01    | 16,52    |       |      |      |      |
| Lletra Tresor 1 any  | 0,02                | 0,02       | 0,02     | 0,02     | 0,02     |       |      |      |      |
| ICE Bank of America EMU Large Cap Investment Grade 1-3 year (EML1) | 0,40                | 0,65       | 0,23     | 0,23     | 0,35     |       |      |      |      |

| CAIXABANK AHORRO, FI CLASE ESTANDAR | Acumulat any actual | Trimestral |          |          |          | Anual |      |      |      |
|-------------------------------------|---------------------|------------|----------|----------|----------|-------|------|------|------|
|                                     |                     | 31-12-21   | 30-09-21 | 30-06-21 | 31-03-21 | 2020  | 2019 | 2018 | 2016 |
| <b>Volatilitat* de:</b>             |                     |            |          |          |          |       |      |      |      |
| Valor Liquidatiu                    | 0,42                | 0,59       | 0,24     | 0,31     | 0,44     |       |      |      |      |
| VaR històric **                     | 0,25                | 0,25       | 0,14     | 0,14     |          |       |      |      |      |

| CAIXABANK AHORRO, FI CLASE PLUS | Acumulat any actual | Trimestral |          |          |          | Anual |      |      |      |
|---------------------------------|---------------------|------------|----------|----------|----------|-------|------|------|------|
|                                 |                     | 31-12-21   | 30-09-21 | 30-06-21 | 31-03-21 | 2020  | 2019 | 2018 | 2016 |
| <b>Volatilitat* de:</b>         |                     |            |          |          |          |       |      |      |      |
| Valor Liquidatiu                | 0,42                | 0,59       | 0,24     | 0,31     | 0,44     |       |      |      |      |
| VaR històric **                 | 0,25                | 0,25       | 0,14     | 0,14     |          |       |      |      |      |

| CAIXABANK AHORRO, FI CLASE PREMIUM | Acumulat any actual | Trimestral |          |          |          | Anual |      |      |      |
|------------------------------------|---------------------|------------|----------|----------|----------|-------|------|------|------|
|                                    |                     | 31-12-21   | 30-09-21 | 30-06-21 | 31-03-21 | 2020  | 2019 | 2018 | 2016 |
| <b>Volatilitat* de:</b>            |                     |            |          |          |          |       |      |      |      |
| Valor Liquidatiu                   | 0,42                | 0,59       | 0,24     | 0,31     | 0,44     |       |      |      |      |
| VaR històric **                    | 0,25                | 0,25       | 0,14     | 0,14     |          |       |      |      |      |

**CAIXABANK AHORRO, FI C INSTITUCIONAL**

| Volatilitat * de: | Acumulat any actual | Trimestral |          |          |          | Anual |      |      |      |
|-------------------|---------------------|------------|----------|----------|----------|-------|------|------|------|
|                   |                     | 31-12-21   | 30-09-21 | 30-06-21 | 31-03-21 | 2020  | 2019 | 2018 | 2016 |
| Valor Liquidatiu  | 0,41                | 0,59       | 0,24     | 0,31     | 0,44     |       |      |      |      |
| VaR històric **   | 0,24                | 0,24       | 0,12     | 0,12     |          |       |      |      |      |

**CAIXABANK AHORRO, FI CLASE CARTERA**

| Volatilitat * de: | Acumulat any actual | Trimestral |          |          |          | Anual |      |      |      |
|-------------------|---------------------|------------|----------|----------|----------|-------|------|------|------|
|                   |                     | 31-12-21   | 30-09-21 | 30-06-21 | 31-03-21 | 2020  | 2019 | 2018 | 2016 |
| Valor Liquidatiu  | 0,42                | 0,59       | 0,24     | 0,31     | 0,44     |       |      |      |      |
| VaR històric **   | 0,23                | 0,23       | 0,12     | 0,12     |          |       |      |      |      |

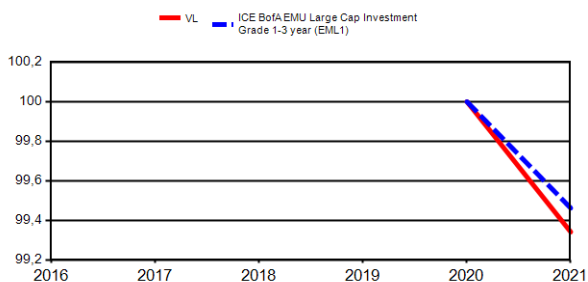
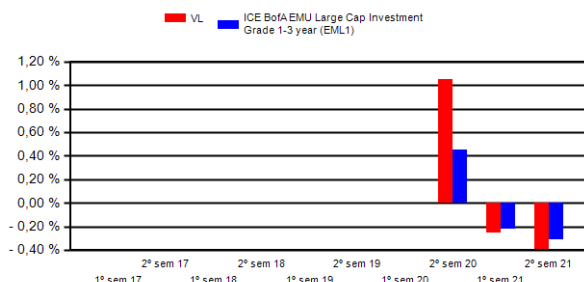
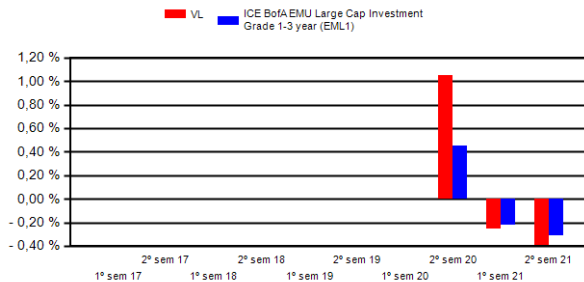
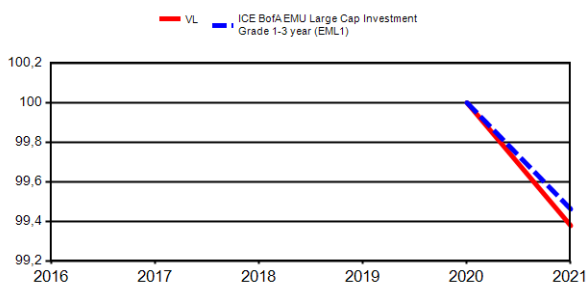
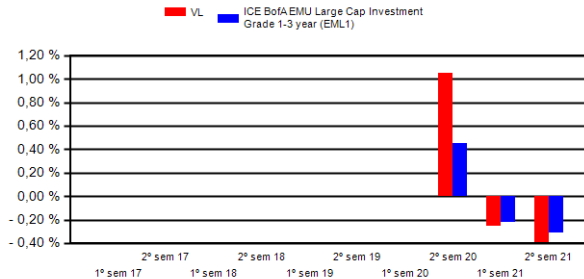
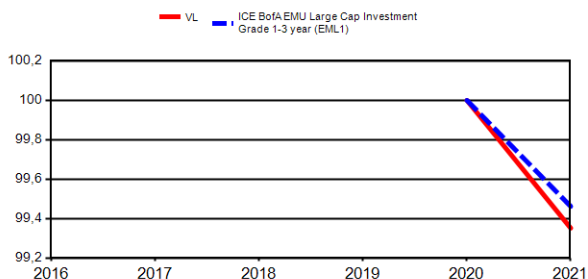
\* Volatilitat històrica: indica el risc d'un valor en un període, a més volatilitat més risc. Per poder comparar s'ofereix la volatilitat de diferents referències. Només s'informa de la volatilitat per als períodes amb política d'inversió homogènia.

\*\* VaR històric: indica el màxim que es pot perdre, amb un nivell de confiança del 99%, en el termini d'1 mes, si es repeteix el comportament de la IIC dels últims 5 anys. La dada és a finals del període de referència.

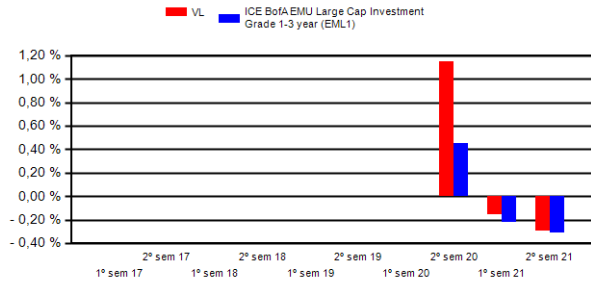
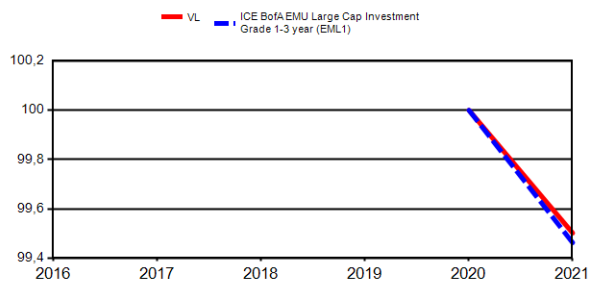
**Despeses (% s/ patrimoni mitjà)**
**CAIXABANK AHORRO, FI**

| Ràtio total de despeses * | Acumulat any actual | Trimestral |          |          |          | Anual |      |      |      |
|---------------------------|---------------------|------------|----------|----------|----------|-------|------|------|------|
|                           |                     | 31-12-21   | 30-09-21 | 30-06-21 | 31-03-21 | 2020  | 2019 | 2018 | 2016 |
| CLASE ESTANDAR            | 0,51                | 0,13       | 0,13     | 0,13     | 0,13     | 0,51  | 0,51 | 0,51 | 0,54 |
| CLASE PLUS                | 0,51                | 0,13       | 0,13     | 0,13     | 0,13     | 0,51  | 0,51 | 0,51 | 0,53 |
| CLASE PREMIUM             | 0,51                | 0,13       | 0,13     | 0,13     | 0,13     | 0,51  | 0,51 | 0,51 | 0,54 |
| C INSTITUCIONAL           | 0,31                | 0,08       | 0,08     | 0,08     | 0,08     | 0,31  | 0,31 | 0,31 | 0,31 |
| CLASE CARTERA             | 0,23                | 0,06       | 0,06     | 0,06     | 0,06     | 0,23  | 0,23 | 0,23 |      |

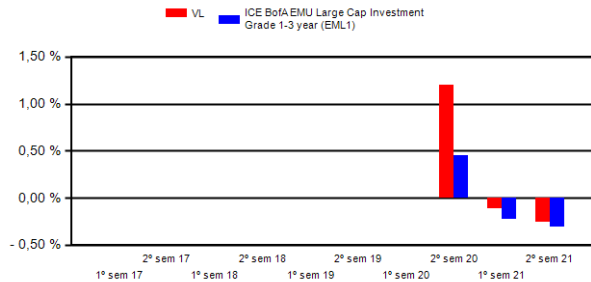
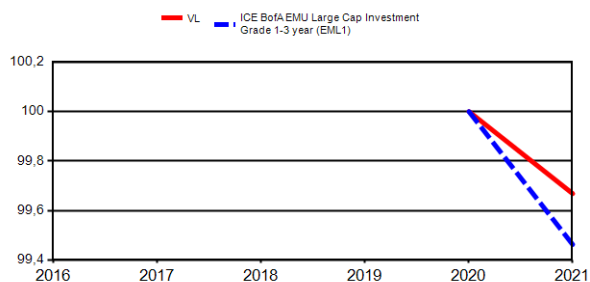
\* Inclou totes les despeses directes que hi ha hagut en el període de referència: comissió de gestió sobre patrimoni, comissió de depositari, auditoria, serveis bancaris (excepte despeses de finançament) i la resta de despeses de gestió corrent, en termes de tant per cent sobre el patrimoni mitjà del període. En cas de fons/compartiments que inverteixen més d'un 10% del patrimoni en altres IIC s'inclouen també les despeses efectuades indirectament, derivades d'aquestes inversions, que inclouen les comissions de subscripció i de reemborsament. Aquest ràtio no inclou la comissió de gestió sobre resultats ni els costos per la compravenda de valors.

**Evolució del valor liquidatiu darrers 5 anys**
**CAIXABANK AHORRO, FI CLASE ESTANDAR**

**Rendibilitat semestral dels últims 5 anys**

**CAIXABANK AHORRO, FI CLASE PLUS**

**CAIXABANK AHORRO, FI CLASE PREMIUM**


### CAIXABANK AHORRO, FI C INSTITUCIONAL



### CAIXABANK AHORRO, FI CLASE CARTERA



#### 2.2.2. Comparativa

Durant el període de referència, la rendibilitat mitjana en el període de referència dels fons gestionats per la societat gestora es presenta en el quadre adjunt. Els fons s'agrupen segons la vocació inversora.

| Vocación inversora   | Patrimonio gestionado*<br>(miles de euros) | Nº de participes* | Rendibilitat semestral mitjana** |
|--|--|-------------------|----------------------------------|
| Renda fixa euro  | 14.341.917                                 | 1.465.344         | -0,60                            |
| Renda fixa internacional   | 3.161.545                                  | 636.846           | 1,22                             |
| Renda fixa mixta euro  | 2.882.826                                  | 90.986            | -0,51                            |
| Renda fixa mixta internacional                                   | 8.284.303                                  | 233.901           | 1,34                             |
| Renda variable mixta euro  | 34.342                                     | 2.156             | 3,25                             |
| Renda variable mixta internacional                               | 3.620.361                                  | 115.996           | 0,19                             |
| Renda variable euro  | 681.260                                    | 207.203           | -0,13                            |
| Renda variable internacional                                     | 14.727.265                                 | 1.802.899         | 9,43                             |
| IIC de gestió passiva (I)  | 2.436.529                                  | 84.503            | 1,69                             |
| Garantit de rendiment fix  | 546.957                                    | 17.484            | -0,76                            |
| Garantit de rendiment variable                                   | 1.169.690                                  | 50.221            | -0,18                            |
| De garantia parcial  | 0  | 0                 | 0,00                             |
| Retorn absolut   | 2.826.683                                  | 344.310           | 1,50                             |
| Global   | 13.200.301                                 | 472.879           | 3,88                             |
| FMM a curt termini de valor liquidatiu variable                  | 0  | 0                 | 0,00                             |
| FMM a curt termini de valor liquidatiu constant de deute publica | 0  | 0                 | 0,00                             |
| FMM a curt termini de valor liquidatiu de baixa volatilitat      | 0  | 0                 | 0,00                             |
| FMM estàndard de valor liquidatiu variable                       | 3.904.914                                  | 85.263            | -0,26                            |
| Renda fixa euro curt termini                                     | 6.324.837                                  | 407.540           | -0,29                            |
| IIC que replica un índex   | 502.383                                    | 9.551             | 3,63                             |
| IIC amb objectiu concret de rendibilitat no garantit             | 0  | 0                 | 0,00                             |
| <b>Total Fons</b>  | <b>78.646.112</b>                          | <b>6.027.082</b>  | <b>2,57</b>                      |

\*Mitjanes.

(I): inclou IIC que reproduïxen un índex, fons cotitzats (ETF) i IIC amb objectiu concret de rendibilitat no garantit.

\*\* Rendibilitat mitjana ponderada per patrimoni mitjà de cada FI en el període

### 2.3. DISTRIBUCIÓ DEL PATRIMONI AL TANCAMENT DEL PERÍODE (IMPORTS EN MILERS DE EUROS)

| Distribució del patrimoni                  | Fi període actual |                   | Fi període anterior |                   |
|--|-------------------|-------------------|---------------------|-------------------|
|  | Import            | % sobre patrimoni | Import              | % sobre patrimoni |
| (+) INVERSIONS FINANCERES                  | 889.286           | 93,62             | 861.993             | 90,00             |
| * Cartera interior                         | 94.278            | 9,92              | 180.234             | 18,82             |
| * Cartera exterior                         | 806.916           | 84,95             | 686.829             | 71,71             |
| * Interessos cartera inversió              | -11.908           | -1,25             | -5.069              | -0,53             |
| * Inversions dubtoses, moroses o en litigi | 0                 | 0,00              | 0                   | 0,00              |
| (+) LIQUIDATAT (TRESORERIA)                | 58.903            | 6,20              | 95.157              | 9,94              |
| (+/-) RESTA                                | 1.735             | 0,18              | 616                 | 0,06              |
| <b>TOTAL PATRIMONI</b>                     | <b>949.923</b>    | <b>100,00</b>     | <b>957.767</b>      | <b>100,00</b>     |

Notes:

El període fa referència al trimestre o semestre, segons el cas.

Les inversions financeres s'indiquen a valor estimat de realització.

## 2.4. ESTAT DE VARIACIÓ PATRIMONIAL

|  | % sobre patrimoni mitjà     |                               |                          | % Variació respecte fi període anterior |
|--|-----------------------------|-------------------------------|--------------------------|---|
|  | Variació del període actual | Variació del període anterior | Variació acumulada anual |   |
| <b>PATRIMONI FI PERIODE ANTERIOR (milers de euros)</b> | <b>957.767</b>              | <b>822.184</b>                | <b>822.184</b>           |   |
| ± Subscripcions/ reemborsaments (net)                  | -0,50                       | 16,75                         | 14,75                    | -103,54                                 |
| Beneficis bruts distribuïts                            | 0,00                        | 0,00                          | 0,00                     | 0,00                                    |
| ± Rendiments nets                                      | -0,31                       | -0,19                         | -0,50                    | -1.870,13                               |
| (+) Rendiments de gestió                               | -0,13                       | 0,01                          | -0,13                    | -2.070,82                               |
| + Interessos   | 0,44                        | 0,40                          | 0,84                     | 28,90                                   |
| + Dividends  | 0,00                        | 0,03                          | 0,02                     | -100,00                                 |
| ± Resultats en renda fixa (fetes o no)                 | -0,66                       | -0,55                         | -1,22                    | 44,85                                   |
| ± Resultats en renda variable (fetes o no)             | 0,00                        | 0,00                          | 0,00                     | 0,00                                    |
| ± Resultat en dipòsits (fetes o no)                    | 0,00                        | 0,00                          | 0,00                     | 0,00                                    |
| ± Resultat en derivats (fetes o no)                    | 0,08                        | 0,14                          | 0,22                     | -34,55                                  |
| ± Resultat en IIC (fetes o no)                         | -0,02                       | -0,05                         | -0,06                    | -57,64                                  |
| ± Altres resultats                                     | 0,03                        | 0,03                          | 0,06                     | 48,46                                   |
| ± Altres rendiments                                    | 0,00                        | 0,00                          | 0,00                     | 0,00                                    |
| (-) Despeses repercutides                              | -0,18                       | -0,20                         | -0,37                    | 7,35                                    |
| - Comissió de gestió                                   | -0,15                       | -0,17                         | -0,32                    | 7,91                                    |
| - Comissió de dipositori                               | -0,02                       | -0,02                         | -0,03                    | 6,49                                    |
| - Despeses per serveis exteriors                       | 0,00                        | -0,01                         | -0,01                    | -3,89                                   |
| - Altres despeses de gestió corrent                    | 0,00                        | 0,00                          | 0,00                     | -2,62                                   |
| - Altres despeses repercutides                         | 0,00                        | 0,00                          | 0,00                     | -100,00                                 |
| (+) Ingressos  | 0,00                        | 0,00                          | 0,00                     | 193,35                                  |
| + Comissions de descompte a favor de la IIC            | 0,00                        | 0,00                          | 0,00                     | 0,00                                    |
| + Comissions retrocedides                              | 0,00                        | 0,00                          | 0,00                     | 0,00                                    |
| + Altres ingressos                                     | 0,00                        | 0,00                          | 0,00                     | 193,35                                  |
| <b>PATRIMONI FI PERIODE ACTUAL (milers de euros)</b>   | <b>949.923</b>              | <b>957.767</b>                | <b>949.923</b>           |   |

Nota: el període fa referència al trimestre o semestre, segons el cas.

## 3. INVERSIONS FINANCERES

### 3.1. INVERSIONS FINANCERES A VALOR ESTIMAT DE REALITZACIÓ (EN MILERS DE EUROS) AL TANCAMENT DEL PERIODE

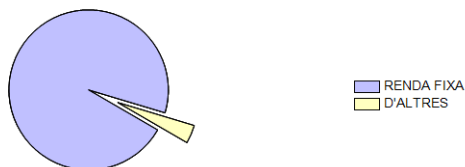
| Descripció de la inversió i emissor                     | Divisa | Període actual  |              | Període anterior |              |
|---|--------|-----------------|--------------|------------------|--------------|
|   |        | Valor de mercat | %            | Valor de mercat  | %            |
| BONOS TESORO PUBLICO .25 2024-07-30                     | EUR    | 47.372          | 4,99         | 35.354           | 3,69         |
| <b>Total deute públic cotitzat més d'1 any</b>          |        | <b>47.372</b>   | <b>4,99</b>  | <b>35.354</b>    | <b>3,69</b>  |
| BONOS ADIF .8 2023-07-05                                | EUR    | 13.339          | 1,40         | 13.322           | 1,39         |
| <b>Total renda fixa privada cotitzada més d'1 any</b>   |        | <b>13.339</b>   | <b>1,40</b>  | <b>13.322</b>    | <b>1,39</b>  |
| BONOS CAIXABANK 3.375 2022-03-15                        | EUR    | 1.569           | 0,17         | 1.558            | 0,16         |
| <b>Total renda fixa privada cotitzada menys d'1 any</b> |        | <b>1.569</b>    | <b>0,17</b>  | <b>1.558</b>     | <b>0,16</b>  |
| <b>TOTAL RENDA FIXA COTITZADA</b>                       |        | <b>62.280</b>   | <b>6,56</b>  | <b>50.234</b>    | <b>5,24</b>  |
| REPO TESORO PUBLICO -1 2022-01-03                       | EUR    | 22.943          | 2,42         |                  |              |
| REPO TESORO PUBLICO -1 2022-01-03                       | EUR    | 9.057           | 0,95         |                  |              |
| REPO TESORO PUBLICO -515 2021-07-01                     | EUR    |                 |              | 130.002          | 13,57        |
| <b>TOTAL ADQUISICIÓ TEMPORAL D'ACTIUS</b>               |        | <b>32.000</b>   | <b>3,37</b>  | <b>130.002</b>   | <b>13,57</b> |
| <b>TOTAL RENDA FIXA</b>                                 |        | <b>94.280</b>   | <b>9,93</b>  | <b>180.236</b>   | <b>18,81</b> |
| <b>TOTAL RENDA VARIABLE</b>                             |        |                 |              |                  |              |
| <b>TOTAL INVERSIONS FINANCERES INTERIOR</b>             |        | <b>94.280</b>   | <b>9,93</b>  | <b>180.236</b>   | <b>18,81</b> |
| BONOS AUSTRIA 1.75 2023-10-20                           | EUR    | 14.255          | 1,50         |                  |              |
| BONOS BELGIUM .2 2023-10-22                             | EUR    | 17.041          | 1,79         | 8.895            | 0,93         |
| BONOS ITALY 4.5 2024-03-01                              | EUR    | 14.257          | 1,50         | 14.316           | 1,49         |
| BONOS ITALY .95 2023-03-01                              | EUR    | 9.278           | 0,98         | 9.300            | 0,97         |
| BONOS ITALY 2.45 2023-10-01                             | EUR    | 61.328          | 6,46         | 22.451           | 2,34         |
| BONOS EIRE 1.35 2031-03-18                              | EUR    | 10.139          | 1,07         | 10.167           | 1,06         |
| BONOS ITALY   2024-04-15                                | EUR    | 20.522          | 2,16         | 14.583           | 1,52         |
| BONOS PORTUGAL 4.95 2023-10-25                          | EUR    | 11.592          | 1,22         | 11.591           | 1,21         |
| BONOS EIRE 3.4 2024-03-18                               | EUR    | 4.847           | 0,51         | 4.844            | 0,51         |
| BONOS LAND NORDRHEIN- .125 2023-03-16                   | EUR    | 10.119          | 1,07         | 10.121           | 1,06         |
| BONOS FRECH TREASURY 4.25 2023-10-25                    | EUR    | 37.271          | 3,92         | 28.389           | 2,96         |
| BONOS FRECH TREASURY 1.75 2023-05-25                    | EUR    | 14.820          | 1,56         | 14.823           | 1,55         |
| BONOS FRECH TREASURY 2.25 2024-05-25                    | EUR    | 43.671          | 4,60         | 43.694           | 4,56         |
| <b>Total deute públic cotitzat més d'1 any</b>          |        | <b>269.142</b>  | <b>28,34</b> | <b>193.172</b>   | <b>20,16</b> |
| LETRAS ITALY  2022-05-13                                | EUR    | 53.266          | 5,61         | 53.250           | 5,56         |
| BONOS ITALY 5.5 2022-11-01                              | EUR    | 71.733          | 7,55         | 71.900           | 7,51         |
| <b>Total deute públic cotitzat menys d'1 any</b>        |        | <b>124.999</b>  | <b>13,16</b> | <b>125.150</b>   | <b>13,07</b> |
| BONOS NED WATERSCHAPS .25 2024-06-07                    | EUR    | 12.725          | 1,34         | 12.776           | 1,33         |
| BONOS CARLSBERG A/S .5 2023-09-06                       | EUR    | 7.124           | 0,75         | 7.128            | 0,74         |
| BONOS TOTAL CAPITAL SJ .625 2024-10-04                  | EUR    |                 |              | 5.727            | 0,60         |
| BONOS TELEFONICA NL 3 2022-12-05                        | EUR    | 3.128           | 0,33         | 5.190            | 0,54         |
| BONOS EUROPEAN COMMUN .00001 2025-11-04                 | EUR    | 30.287          | 3,19         | 20.149           | 2,10         |
| BONOS EUROPEAN COMMUN .0001 2028-06-02                  | EUR    | 8.167           | 0,86         | 8.195            | 0,86         |
| BONOS EUROPEAN COMMUN  2026-03-04                       | EUR    | 13.421          | 1,41         | 13.459           | 1,41         |
| BONOS EUROPEAN COMMUN  2026-07-06                       | EUR    | 2.542           | 0,27         |                  |              |
| BONOS CASSA DEPOSITI  2.125 2023-09-27                  | EUR    | 10.528          | 1,11         | 10.536           | 1,10         |
| BONOS AXA .5.125 2043-07-04                             | EUR    | 17.923          | 1,89         |                  |              |
| BONOS INTESA SANPAOLO .6.625 2023-09-13                 | EUR    | 11.583          | 1,22         | 11.654           | 1,22         |
| BONOS INTESA SANPAOLO .4 2023-10-30                     | EUR    | 9.146           | 0,96         | 9.174            | 0,96         |
| BONOS BANQUE FED CRED .2.625 2024-03-18                 | EUR    | 9.922           | 1,04         | 9.958            | 1,04         |
| BONOS AXA .3.875 2021-10-08                             | EUR    |                 |              | 8.331            | 0,87         |
| BONOS AT&T .2.4 2024-03-15                              | EUR    | 8.798           | 0,93         | 8.818            | 0,92         |
| BONOS BANK OF AMERICA .2.375 2024-06-19                 | EUR    |                 |              | 3.263            | 0,34         |
| BONOS AGENCE FRANCAIS .1.375 2024-09-17                 | EUR    | 4.764           | 0,50         | 4.774            | 0,50         |

| Descripció de la inversió i emissor                     | Divisa | Període actual  |              | Període anterior |              |
|---|--------|-----------------|--------------|------------------|--------------|
|   |        | Valor de mercat | %            | Valor de mercat  | %            |
| BONOS REPSOL ITL 4.5 2022-03-25                         | EUR    | 3.282           | 0,35         | 3.258            | 0,34         |
| BONOS EUROPEAN INVEST 5 2023-11-15                      | EUR    | 12.328          | 1,30         | 12.342           | 1,29         |
| BONOS MCDONALDS 1 2023-11-15                            | EUR    | 11.280          | 1,19         |                  |              |
| BONOS KREDITANSALT 05 2024-05-30                        | EUR    | 13.829          | 1,46         | 13.850           | 1,45         |
| BONOS ERSTE GR BK AKT 8.875 2099-10-15                  | EUR    |                 |              | 6.341            | 0,66         |
| BONOS BK NEDERLANDSE 05 2024-07-13                      | EUR    | 8.113           | 0,85         | 8.143            | 0,85         |
| BONOS GLENCORE FIN EU 1.875 2023-09-13                  | EUR    | 13.604          | 1,43         | 13.633           | 1,42         |
| BONOS ICO .75 2023-10-31                                | EUR    | 8.750           | 0,92         | 8.746            | 0,91         |
| BONOS ARCELOR 2.25 2024-01-17                           | EUR    | 7.302           | 0,77         |                  |              |
| BONOS ICO .2 2024-01-31                                 | EUR    | 2.291           | 0,24         | 2.289            | 0,24         |
| BONOS E.ON  2024-08-28                                  | EUR    | 12.059          | 1,27         | 6.032            | 0,63         |
| BONOS EURBKRECON  2024-10-17                            | EUR    | 1.072           | 0,11         | 1.076            | 0,11         |
| BONOS NED WATERSCHAPS  2023-04-14                       | EUR    | 10.104          | 1,06         | 10.105           | 1,06         |
| BONOS ICO .25 2024-04-30                                | EUR    | 10.033          | 1,06         | 10.021           | 1,05         |
| BONOS ABN AMRO BANK 1.25 2025-05-28                     | EUR    | 3.534           | 0,37         | 3.560            | 0,37         |
| BONOS STANDARDCHART 2.5 2021-09-09                      | EUR    |                 |              | 7.735            | 0,81         |
| BONOS REPSOL ITL .125 2024-10-05                        | EUR    | 13.067          | 1,38         |                  |              |
| BONOS IBER INTL 1.874 2022-04-28                        | EUR    |                 |              | 5.864            | 0,61         |
| BONOS GRAND CITY PROP 1.5 2099-03-11                    | EUR    | 5.626           | 0,59         | 5.673            | 0,59         |
| BONOS ELECTRICITE DE 5 2022-01-22                       | EUR    |                 |              | 5.664            | 0,59         |
| BONOS ENGIE SA 3.875 2049-06-02                         | EUR    |                 |              | 7.744            | 0,81         |
| BONOS CR AGRIC ASSURA 4.25 2022-01-13                   | EUR    |                 |              | 9.439            | 0,99         |
| BONOS AGENCE FRANCAIS .125 2023-11-15                   | EUR    | 912             | 0,10         | 913              | 0,10         |
| BONOS ELECTRICITE DE 4 2022-10-04                       | EUR    | 4.132           | 0,43         | 4.128            | 0,43         |
| BONOS CM AREKA 1.25 2029-06-11                          | EUR    | 3.133           | 0,33         | 3.145            | 0,33         |
| BONOS BNP .375 2027-10-14                               | EUR    | 2.988           | 0,31         | 3.009            | 0,31         |
| BONOS ELECTRCPORTUGAL 4.496 2079-04-30                  | EUR    | 5.509           | 0,58         | 5.538            | 0,58         |
| BONOS EUROPEAN INVEST .375 2026-05-15                   | EUR    | 4.127           | 0,43         | 4.155            | 0,43         |
| BONOS VONOVIA SE 1.625 2024-04-07                       | EUR    | 2.169           | 0,23         | 2.190            | 0,23         |
| BONOS VONOVIA SE .125 2023-04-06                        | EUR    | 9.820           | 1,03         | 9.834            | 1,03         |
| <b>Total renda fixa privada cotitzada més d'1 any</b>   |        | <b>319.120</b>  | <b>33,59</b> | <b>313.559</b>   | <b>32,75</b> |
| BONOS E.ON FIN .75 2022-11-30                           | EUR    | 15.199          | 1,60         | 15.245           | 1,59         |
| BONOS UBS GROUP AG 5.75 2022-02-21                      | EUR    | 7.227           | 0,76         |                  |              |
| BONOS VONOVIA SE .75 2022-01-25                         | EUR    | 5.800           | 0,61         | 5.813            | 0,61         |
| BONOS SOCIETE GENERAL -543 2022-01-03                   | EUR    | 5.095           | 0,54         | 5.102            | 0,53         |
| BONOS REPSOL ITL .5 2022-05-23                          | EUR    | 4.586           | 0,48         | 4.592            | 0,48         |
| BONOS TOTAL FINA 3.875 2022-05-18                       | EUR    | 11.161          | 1,17         | 11.149           | 1,16         |
| BONOS BNP 6.125 2022-06-17                              | EUR    | 5.376           | 0,57         | 5.255            | 0,55         |
| BONOS VONOVIA SE .1163 2022-12-19                       | EUR    | 0               | 0,00         | 2.118            | 0,22         |
| BONOS AT&T -.55682143 2022-03-04                        | EUR    | 5.825           | 0,61         | 5.828            | 0,61         |
| <b>Total renda fixa privada cotitzada menys d'1 any</b> |        | <b>60.270</b>   | <b>6,34</b>  | <b>55.102</b>    | <b>5,75</b>  |
| <b>TOTAL RENDA FIXA COTITZADA EXT</b>                   |        | <b>773.531</b>  | <b>81,43</b> | <b>686.982</b>   | <b>71,73</b> |
| <b>TOTAL RENDA FIXA EXT</b>                             |        | <b>773.531</b>  | <b>81,43</b> | <b>686.982</b>   | <b>71,73</b> |
| <b>TOTAL RENDA VARIABLE EXT</b>                         |        |                 |              |                  |              |
| ETF AMUNDI ETFS   | EUR    | 33.415          | 3,52         |                  |              |
| <b>TOTAL IIC EXT</b>                                    |        | <b>33.415</b>   | <b>3,52</b>  |                  |              |
| <b>TOTAL INVERSIONS FINANCERES EXTERIOR</b>             |        | <b>806.946</b>  | <b>84,95</b> | <b>686.982</b>   | <b>71,73</b> |
| <b>TOTAL INVERSIONS FINANCERES</b>                      |        | <b>901.226</b>  | <b>94,88</b> | <b>867.219</b>   | <b>90,54</b> |

Notes: el període es refereix a la fi del trimestre o semestre, segons el cas.

### 3.2. DISTRIBUCIÓ DE LES INVERSIONS FINANCERES, AL TANCAMENT DEL PERÍODE (% RESPECTE AL PATRIMONI TOTAL)

Distribució per tipus d'actiu



### 3.3. OPERACIONS EN DERIVATS

#### RESUM DE LES POSICIONS OBERTES AL TANCAMENT DEL PERÍODE (IMPORTS EN MILERS DE EUROS)

|                                | Instrument                           | Import nominal compromès | Objectiu de la inversió |
|--------------------------------|--------------------------------------|--------------------------|-------------------------|
| Total subjacent renda fixa     |                                      | 0                        |                         |
| Total subjacent renda variable |                                      | 0                        |                         |
| Total subjacent tipus de canvi |                                      | 0                        |                         |
| Total altres subjacents        |                                      | 0                        |                         |
| <b>TOTAL DRETS</b>             |                                      | <b>0</b>                 |                         |
| FUT SCHATZ 2Y                  | FUTURO FUT SCHATZ 2Y 100000 FISICA   | 230.625                  | Inversió                |
| FUT BUND 10Y                   | FUTURO FUT BUND 10Y 100000 FISICA    | 30.769                   | Inversió                |
| F US 2YR NOTE                  | FUTURO F US 2YR NOTE 200000 FISICA   | 54.695                   | Inversió                |
| F SHORT EUROBTB                | FUTURO F SHORT EUROBTB 100000 FISICA | 3.850                    | Inversió                |
| F BOBL                         | FUTURO F BOBL 100000 FISICA          | 65.143                   | Inversió                |
| F 10YR ULTRA                   | FUTURO F 10YR ULTRA 100000 FISICA    | 43.164                   | Inversió                |
| Total subjacent renda fixa     |                                      | 428.247                  |                         |
| Total subjacent renda variable |                                      | 0                        |                         |
| F EUROUSD FIX                  | FUTURO F EUROUSD FIX 125000 USD      | 19.529                   | Inversió                |
| Total subjacent tipus de canvi |                                      | 19.529                   |                         |
| Total altres subjacents        |                                      | 0                        |                         |
| <b>TOTAL OBLIGACIONS</b>       |                                      | <b>447.776</b>           |                         |

### 4. FETS RELLEVANTS

|  | Si | No |
|--|----|----|
| a.Suspensió temporal de subscripcions/reemborsaments |    | X  |
| b.Represa de subscripcions/reemborsaments            |    | X  |
| c.Reemborsament de patrimoni significatiu            |    | X  |
| d.Endeutament superior al 5% del patrimoni           |    | X  |
| e.Substitució de la societat gestora                 |    | X  |
| f.Substitució de l'entitat depositària               |    | X  |
| g.Canvi de control de la societat gestora            |    | X  |
| h.Canvi en elements essencials del fullet informatiu |    | X  |
| i.Autorització del procés de fusió                   |    | X  |
| j.Altres fets rellevants                             | X  |    |

### 5. ANNEX EXPLICATIU DE FETS RELLEVANTS

CaixaBank Asset Management, SGIC, SAU, entitat gestora del fons, comunica les comissions de gestió i depositària del fons, amb entrada en vigor l'1 de juliol del 2021, en aplicació del criteri següent:

Classe Estàndar: mínim (comissió de gestió 1 % + comissió de dipòsit 0,1 %, màxim (0,50 %, EURIBOR a 12 mesos + 0,50 %))

Classe Plus: mínim (comissió de gestió 0,775 % + comissió de dipòsit 0,075 %, màxim (0,50 %, EURIBOR a 12 mesos + 0,50 %))

Classe Premium: mínim (comissió de gestió 0,6 % + comissió de dipòsit 0,05 %, màxim (0,50 %, EURIBOR a 12 mesos + 0,50 %)).

Sabent que la mitjana diària del tancament oficial EURIBOR a 12 mesos durant els darrers 10 dies hàbils de juny del 2021 ha estat -0,480 %, la comissió total en el fons en el període de l'1 de juliol al 31 de desembre del 2021 és:

Classe Estàndar: mínim (comissió de gestió 1 % + comissió de dipòsit 0,1 %, màxim (0,50 %, 0,02 %)) = 0,50 %.

Classe Plus: mínim (comissió de gestió 0,775 % + comissió de dipòsit 0,075 %, màxim (0,50 %, 0,02 %)) = 0,50 %.

Classe Premium: mínim (comissió de gestió 0,6 % + comissió de dipòsit 0,05 %, màxim (0,50 %, 0,02 %)) = 0,50 %.

La comissió total resultant es distribueix de manera que la comissió de depositària és igual al 9 % de la comissió total (comissió de gestió més comissió de depositària), arrodonit el resultat al 0,025 % més pròxim.

En concret, la distribució de comissions en el període de l'1 de juliol al 31 de desembre del 2021 és:

Classe Estàndar:

Comissió de gestió: 0,45 %.

Comissió de depositària: 0,05 %.

Classe Plus:

Comissió de gestió: 0,45 %.

Comissió de depositària: 0,05 %.

Classe Premium:

Comissió de gestió 0,45 %

Comissió de depositària 0,05 %

Es comunica el nomenament del nou auditor de la IIC. El nou auditor és: Pricewaterhousecoopers Auditores, SL.

### 6. OPERACIONS VINCULADES I ALTRES INFORMACIONS

|  | Si | No |
|--|----|----|
| a.Participis significatius en el patrimoni del fons (percentatge superior al 20%)  | X  |    |
| b.Modificacions d'escassa rellevància en el reglament  |    | X  |
| c.La gestora i el depositari són del mateix grup (segons l'article 4 de la CNMV)   |    | X  |
| d.S'han fet operacions d'adquisició i venda de valors en els quals el depositari ha actuat com a venedor o comprador, respectivament   |    | X  |
| e.S'han adquirit valors o instruments financers emesos o avalats per alguna entitat del grup de la gestora o del depositari, o algun d'aquests ha actuat com a col·locador, assegurador, director o assessor, o s'han prestat valors a entitats vinculades |    | X  |
| f.S'han adquirit valors o instruments financers la contrapartida dels quals ha estat una entitat del grup de la gestora o depositari, o una altra IIC gestionada per la mateixa gestora o una altra gestora del grup                                       | X  |    |
| g.S'han percebut ingressos per entitats del grup de la gestora que tenen com a origen comissions o despeses satisfetes per la IIC  |    | X  |
| h.Altres informacions o operacions vinculades  | X  |    |

### 7. ANNEX EXPLICATIU SOBRE OPERACIONS VINCULADES I ALTRES INFORMACIONS

a) El 31 de desembre del 2021 hi ha un participi amb 275.076.157,82 euros, que representen el 28,96 % del patrimoni.

f) L'import total de les adquisicions en el període és 4.603.999.165,00 €. La mitjana de les operacions d'adquisició del període respecte al patrimoni mig representa un 2,57 %.

h) S'han realitzat operacions d'adquisició temporal d'actius amb pacte de recompra amb el depositari, compra/venda d'IIC pròpies i altres per un import en valor absolut de 329,39 €. La mitjana d'aquest tipus d'operacions al període, respecte al patrimoni mig, representa un 0,00 %.

### 8. INFORMACIÓ I ADVERTIMENTS A INSTÀNCIA DE LA CNMV

No aplicable

### 9. ANNEX EXPLICATIU DE L'INFORME PERIÒDIC

#### 1. SITUACIÓ DELS MERCATS I EVOLUCIÓ DEL FONS.

##### a) Visió de la gestora/societat sobre la situació dels mercats.

El segon semestre ha contribuït a tancar un 2021 positiu per als actius de risc en els mercats desenvolupats. Durant el segon semestre, amb un fons de recuperació

econòmica, amb sòlids resultats empresarials i en què les onades de covid han fet (amb especial virulència la variant òmicron al desembre), hem vist que la inflació ha arribat a cotes inèdites les darreres dècades i que els bancs centrals ha anunciat i han començat a executar una retirada gradual del ritme d'estímul en l'economia.

Excepte a la Xina, al llarg del semestre els principals bancs centrals han manifestat preocupació per l'entorn d'inflació i han endurit el to de la seva política monetària, en un entorn i uns nivells encara molt expansius. Des del punt de vista global, l'extraordinària demanda de béns ha provocat embussos en les cadenes de subministrament i pressió sobre els costos. A Europa el subministrament de gas des de Rússia ha estat impactat per qüestions geopolítiques i la manca d'inversió en altres fonts d'energia ha tingut un impacte en els preus. El Banc Central Europeu (BCE) ha mantingut un discurs i una política monetària laxa, tot i que ha confirmat que el seu programa d'emergència de compra d'actius (PEPP) acabaria al març del 2022 i ha programat la reducció per al segon i tercer trimestre del 2022. Tanmateix, la Reserva Federal (Fed) i el Banc d'Anglaterra han reaccionat davant un mercat laboral tensat i les pressions inflacionistes; la Fed ha començat a executar la seva retirada d'estímul i ha anunciat una acceleració del ritme el gener del 2022. En el tancament de l'exercici el mercat descompta entre dues i tres pujades de tipus els dotze mesos vinents. El Banc d'Anglaterra ha apujat el seu tipus de referència a curt termini 0,15 %, fins a 0,25 %, al desembre. La política monetària a la Xina ha pres una direcció contrària a causa de la velocitat de la desacceleració en el seu creixement per la prèvia retirada d'estímul, per l'impacte de les seves mesures de protecció contra el virus, per l'impacte de les seves reformes reguladores i per la preocupació per l'evolució en alguns sectors com ara l'immobiliari. El Banc Popular de la Xina (BPC) ha relaxat la pressió monetària i al desembre ha reduït el seu requisit de reserves a la banca per afrontar un creixement més petit.

En el terreny polític, hi ha hagut eleccions a Alemanya, amb un resultat que ha portat estabilitat i continuïtat, i al Japó, on el successor de Suga, Kishida, ha pogut mantenir el seu partit en el govern i ha anunciat un ambiciós pla d'estímul fiscal. Als EUA el pla fiscal de l'administració Biden s'ha anat aprovant, tot i que amb una mica de dilució sobre el que s'havia inicialment i, de fet, al desembre la seva darrera fase, build back better, no ha aconseguit superar el seu pressupost al Senat. En el quart trimestre la Unió europea ha començat a fer els primers desemborsaments del fons de recuperació Next Generation EU.

Quant a la pandèmia, a la fi de novembre la virulència de la variant òmicron va provocar incertesa respecte del seu potencial impacte econòmic. Tot i la seva capacitat de contagi, la seva gravetat més baixa i el bon funcionament dels vaccins han evitat que molts països afegeixin noves restriccions. Com en les onades anteriors, tindrà un efecte negatiu en el creixement. Els indicadors avançats de desembre han mostrat que el sector serveis (PMI) comença a perdre una part de la seva inèrcia positiva a Europa, el Regne Unit i els EUA. Tot i això, l'activitat industrial global s'ha mantingut sòlida. En agregat, al desembre els indicadors avançats s'han mantingut en terreny d'expansió.

El semestre ha estat complicat per als actius de renda fixa en termes nominals, i les principals corbes de tipus s'han desplaçat lleugerament a l'alça. Als EUA la corba ha recollit el canvi de to de la Fed i els curts terminis han pujat amb força, fet que en el semestre ha provocat un aplanament. A Europa el lleuger moviment advers, afegit als tipus base negatius, ha pesat en la rendibilitat de l'actiu. En la perifèria europea, també amb un comportament negatiu, Espanya ha obtingut un més bon resultat relatiu respecte d'Itàlia i Portugal. Així mateix, els missatges de la Fed i la volatilitat arran de la variant òmicron han afectat els bons corporatius d'alta qualitat creditícia, que han retrocedit lleugerament en el semestre, mentre que la recuperació de desembre ha permès un resultat positiu per als bons de baixa qualitat creditícia (alt rendiment).

El dòlar americà s'ha revalorat respecte de l'euro i ha reflectit la divergència de creixement i de les polítiques monetàries entre tots dos bancs centrals.

#### **b) Decisions generals d'inversió que s'han adoptat.**

Durant el semestre el debat sobre el repunt de la inflació ha estat un dels temes principals. La transitorietat que els bancs centrals s'han obstinat a continuar mantenint no ha estat compartida pel mercat. Amb això, els mercats s'han debatut entre unes expectatives més agressives de retirada d'estímul dels bancs centrals per frenar una inflació en xifres històricament elevades i les possibles conseqüències econòmiques de la pandèmia, especialment a Europa, on s'han tornat a prendre mesures restrictives en alguns països, en primera instància per l'augment de contagis de la variable delta i, en segona per la incertesa provocada per l'aparició d'una nova variant de covid-19, l'òmicron. Amb un creixement que es mostrava resistent i una inflació que no cessava, a poc a poc els bancs centrals començaven a validar les expectatives del mercat de la necessitat d'adoptar una política més agressiva.

Amb aquest canvi de rumb dels bancs centrals, especialment de la Reserva Federal, hem anat adoptant una posició de més prudència en l'evolució dels tipus d'interès i el seu impacte en els actius de risc. Aquest canvi ha requerit una gestió molt dinàmica de la durada, de la posició en corba i de l'exposició al mercat de crèdit.

La gestió de la durada s'ha dut a terme, principalment, amb el futur del bo alemany a 10 anys i amb el futur a 2 anys del tresor dels EUA. Durant el semestre, el posicionament en durada ha estat generalment prudent. A la fi del període, com que més és més imminent la pujada de tipus als EUA, implementem una estratègia d'aplanament en el tram 2-10 anys de la corba dels EUA i s'ha comprat 2 % de dòlar. A més, es compra govern italià a curt termini després de l'ampliació experimentada per la seva prima.

En renda fixa privada s'ha reduït pes i així s'han pres beneficis i s'ha dut a terme una gestió activa de l'exposició amb l'ús de CDS.

#### **c) Índex de referència.**

El fons té com a índex de referència el Bank of America Merrill Lynch EMU Large Cap Investment Grade 1-3 anys (EML1). La gestió pren com a referència la rendibilitat de l'índex solament a l'efecte informatiu o comparatiu.

#### **d) Evolució del patrimoni, participis, rendibilitat i despeses de la IIC.**

El patrimoni del fons ha disminuït en el període 7,6 % en la classe Estàndar, 13,1 % en la classe Plus, 1,2 % en la classe Premium i 50 % en la classe Institucional, mentre que ha augmentat 20,4 % en la classe Cartera.

El nombre de participis ha baixat 7,6 % en la classe Estàndar, ha baixat 13,1 % en la classe Plus, ha baixat 11,2 % en la classe Premium i ha baixat 50 % en la classe Institucional, mentre que ha pujat 20,4 % en la classe Cartera.

Les despeses del fons en el període han estat 0,26 % en la classe Estàndar, Plus i Premium, 0,16 % en la classe Institucional i 0,12 % en la classe Cartera.

La rendibilitat neta del fons ha estat -0,39 % en la classe Estàndar, Plus i Premium, -0,29 % en la classe Institucional i -0,25 % en la classe Cartera. Aquestes rendibilitats han estat superiors a la del seu índex de referència, que ha estat -0,31 %, en el cas de la classe Institucional i la classe Cartera, però inferiors en el cas de les classes Estàndar, Plus i Premium.

#### **e) Rendiment del fons en comparació de la resta de fons de la gestora.**

La rendibilitat de la classe Cartera ha estat superior a la rendibilitat mitjana de la seva categoria, renda fixa euro curt termini, que ha estat -0,29 %, ha estat igual a la rendibilitat mitjana de la seva categoria en la classe Institucional i ha estat inferior a la rendibilitat mitjana de la seva categoria en les classes Estàndar, Plus i Premium.

## **2. INFORMACIÓ SOBRE LES INVERSIONS.**

### **a) Inversions concretes que s'han fet durant el període.**

El fons ha gestionat de manera molt activa la durada. Durant el juliol, a mesura que s'han incrementat les preocupacions per la ràpida expansió de la variant delta, s'ha apujat la durada fins a 2 anys. Posteriorment, amb una Reserva Federal que comença a anunciar el pas cap a una política monetària menys adaptable es comença a reduir gradualment la durada fins a 1,6 anys. Amb aquesta baixada s'ha volgut protegir al fons d'una eventual pujada de tipus als EUA i del seu possible contagi a l'eurozona. Posteriorment, la durada s'ha mantingut estable en 1,6 fins a les darreres setmanes de l'any, en què s'ha decidit tornar a la zona d'1,9 anys amb l'objectiu de protegir la cartera de la volatilitat derivada de la baixa liquiditat del mercat pròpia dels darrers dies de l'any.

La gestió del risc de tipus d'interès s'ha dut a terme, principalment, amb futurs de govern tant d'Alemanya com dels EUA. En el cas alemany les vendes s'han concentrat en el futur a 10 anys. En el cas dels EUA, però, les vendes s'han fet en el futur a 2 anys. A la fi del període, com que més és més imminent la pujada de tipus als EUA, implementem una estratègia d'aplanament en el tram 2-10 anys de la corba dels EUA i s'ha comprat un 2 % de dòlar. Els darrers dies de l'any s'ha apujat el nivell de durada amb la compra del futur a 10 anys del tresor americà. Addicionalment, es compra govern italià a curt termini després de l'ampliació experimentada per la seva prima.

Pel que fa a renda fixa privada, s'han fet vendes amb coitzacions que ja ens semblen cares, s'ha reduït el pes en crèdit i s'ha gestionat activament l'exposició, implementant cobertura amb CDS a principi del mes de setembre per aixecar-la posteriorment. Addicionalment, s'ha incorporat a la cartera un ETF de crèdit que cerca la sostenibilitat en les seves inversions, Amundi Index Euro Corporate SRI 1-3 Y.

La gestió de la durada ha estat el principal contribuïdor a la rendibilitat del fons. La posició en el futur dels EUA a 2 anys ha aportat 0,08 %. Per part seva, les posicions en futurs de govern alemany a 10, 5 i 2 anys han contribuït amb 0,03 %, 0,03 % i 0,02 %, respectivament. Entre la resta de posicions que més han aportat destaca, amb una aportació de 0,01 %, la posició en el bo subordinat de Telefónica XS1795406575. En la banda negativa el principal detractor ha estat la posició mantinguda en el futur de dòlar, que ha restat -0,05 %. També han il·lustrat rendibilitat en una magnitud de -0,02 % l'ETF Amundi Index Euro Corporate SRI 1-3, Unió Europea de venciment 2025 EU000A284451, el bo de Govern italià de venciment 2023 IT0005344335 i el bo de govern francès venciment 2024 FR0011619436. També ha restat -0,02 % a la rendibilitat del fons la posició comprada en futur a 10 anys de tresor americà.

### **b) Operacions de préstec de valors.**

N/A

### **c) Operacions en derivats i adquisició temporal d'actius.**

El fons ha dut a terme operacions amb instruments derivats per complementar les posicions de renda fixa per gestionar d'una manera més eficaç la cartera. El grau mitjà de palanquejament ha estat 36,75 %.

### **d) Més informació sobre inversions.**

Amb data de referència (31/12/2021) el fons manté una cartera d'actius de renda fixa amb una vida mitjana d'1,98 anys i amb una TIR mitjana bruta (això sense descomptar les despeses i comissions imputables al fons d'inversió) a preus de mercat de -0,28 %. Aquesta dada reflecteix, en la data de referència de la informació, la rendibilitat que en termes bruts (calculada com a mitjana de les taxes internes de retorn o TIR dels actius de la cartera) obtindria en el futur el fons d'inversió pel manteniment de les seves inversions en el venciment. La rendibilitat finalment obtinguda pel fons serà diferent, afectada, de primer, per les despeses i comissions imputables a la IIC i a conseqüència de possibles canvis en els actius mantinguts en cartera o l'evolució de mercat dels tipus d'interès i del crèdit dels emissors. La rendibilitat mitjana de la liquiditat durant el període ha estat -0,37 %. Aquest fons pot invertir un tant per cent de 20 % en emissions de renda fixa de baixa qualitat creditícia, això és, amb alt risc de crèdit.

## **3. EVOLUCIÓ DE L'OBJECTIU CONCRET DE RENDIBILITAT.**

N/A

## **4. RISC ASSUMIT PEL FONS.**

La volatilitat del fons ha estat 0,59 %, inferior a la de l'índex de referència, que ha estat 0,65 %, i superior a la de la lletra del tresor a un any, que ha estat 0,02 %.

## **5. EXERCICI DE DRETS POLÍTICS.**

N/A

## **6. INFORMACIÓ I ADVERTIMENTS CNMV.**

N/A

## **7. ENTITATS BENEFICIÀRIES DEL FONS SOLIDARI I IMPORT CEDIT A LES ENTITATS.**

N/A

## **8. COSTOS DERIVATS DEL SERVEI D'ANÀLISI.**

Els proveïdors de recerca de renda fixa triats han aportat valor a la gestió:

En renda fixa, l'anàlisi externa ha ajudat a elaborar expectatives sobre l'evolució dels tipus d'interès, escenaris i probabilitats necessàries per decidir la durada de les carteres i les preferències en venciments.

Quant a la selecció d'actius de renda fixa (assignació d'actius en bons), l'anàlisi externa ha completat l'intern per definir la ponderació d'actius emesos per entitats públiques respecte de les privades, la d'actius amb grau d'inversió respecte d'alt rendiment, la d'actius sènior respecte de subordinats i les preferències per sectors i països.

Des del punt de vista micro, és molt rellevant l'aportació de valor dels equips d'anàlisi dels nostres proveïdors externs de recerca. Els gestors de CaixaBank Asset Management han seleccionat emissors i emissions amb el suport de les recomanacions d'aquests analistes.



Destaquen com a proveïdors de renda fixa: CreditSights, Bank of America Securities, J. P. Morgan, BNP Paribas i Barclays Bank, amb una remuneració conjunta del 63 % de les despeses totals.

Les despeses d'anàlisi que ha tingut la institució d'inversió col·lectiva durant l'exercici 2021 han pujat a 3.731,82 € i les despeses previstes per a l'exercici 2022 es considera que seran 3.490,11 €.

#### 9. COMPARTIMENTS DE PROPÒSIT ESPECIAL (SIDE POCKETS).

N/A

#### 10. PERSPECTIVES DE MERCAT I ACTUACIÓ PREVISIBLE DEL FONDS.

En l'exercici 2022 el teló de fons continuarà sent un entorn de recuperació econòmica global que es manté sense fissures i que continua empès per les polítiques econòmiques ja aplicades. Una de les incògnites per a aquest entorn de creixement és la desacceleració del creixement xinès, en què esperem que el govern mantindrà una política econòmica més expansiva.

Esperem menys impacte de la covid-19 en els mercats, en unes economies que s'han aconseguit adaptar i uns vaccins que funcionen. Per contra, esperem més inestabilitat a causa dels riscos geopolítics, en què les relacions entre Rússia i Europa i els EUA marcaran el pas.

Els bancs centrals desenvolupats inicien una fase de tornada a la normalitat amb l'objectiu de protegir les seves economies d'unes taxes d'inflació que registraran nivells molt tensats els primers mesos de l'any, per retrocedir parcialment després. La disparitat entre bancs centrals provoca incertesa per un possible error de política monetària. La cotització d'aquest risc pot pesar sobre els trams llargs de la corba de tipus.

Els mercats financers hauran de calibrar l'increment de risc i la progressiva pèrdua del suport que han comportat unes polítiques econòmiques tan expansives.

El mercat de renda fixa haurà de fer front a la divergència de polítiques monetàries, amb retirades d'estímul i pujades de tipus en algunes economies. Serà un exercici especialment tàctic, amb valor especial de les apostes relatives en la corba de tipus i geogràfiques. A diferència del nostre posicionament general per a l'exercici anterior, no establim una marcada preferència per la renda fixa corporativa per al 2022, que estarà afectada, d'una banda, per la retirada de les compres dels bancs centrals i, de l'altra, per un entorn sòlid de creixement econòmic.

Mantenim una visió en rang lateral sobre la divisa americana respecte de l'euro a causa de la divergència de polítiques monetàries i un sòlid creixement a Europa.

En el tancament del període el fons té una TIR del -0,28 % amb una vida mitjana d'1,98 anys.

## 10. INFORMACIÓ SOBRE LA POLÍTICA DE REMUNERACIÓ

### 1) Dades quantitatives:

- Remuneració total abonada per la SGIIIC al seu personal desglossada en:
  - Remuneració fixa: 16.596.399 euros
  - Remuneració variable: 2.048.379 euros
- Nombre de beneficiaris:
  - Nombre total d'empleats: 277
  - Nombre de beneficiaris: 262
- Remuneració vinculada a la comissió de gestió variable de la IIC
- No existeix aquest tipus de remuneració
- Remuneració desglossada en:
  - Alts càrrecs:
    - Nombre de persones: 9
    - Remuneració fixa: 1.390.500 euros
    - Remuneració variable: 314.591 euros
  - Empleats amb una actuació que tingui una incidència material en el perfil de risc de la IIC
    - Nombre de persones: 8
    - Remuneració fixa: 1.092.000 euros
    - Remuneració variable: 339.884 euros

### 2) Contingut qualitatiu:

La política de remuneració de CaixaBank Asset Management constitueix un aspecte fonamental del seu govern corporatiu, a causa de la influència potencial que les pràctiques de remuneració poden exercir en el perfil de risc de la SGIIIC i de les IIC que gestiona, així com en els conflictes d'interès potencials, tot això d'acord amb la normativa sectorial aplicable.

CaixaBank AM, com a SGIIIC i prestadora de serveis d'inversió, requereix dotar-se d'unes polítiques adequades de remuneració, tant en relació amb els alts directius, els prenedors de risc i les persones que exerceixen funcions de control com en general amb la resta del personal de l'entitat.

D'acord amb això, CaixaBank AM disposa d'una política de remuneració per als seus empleats segons una gestió racional i eficaç del risc, i la normativa aplicable a les IIC gestionades. Aquesta política segueix els principis de l'estratègia empresarial, dels objectius, dels valors i dels interessos a llarg termini propis i de les institucions d'inversió col·lectiva que gestiona, dels seus participants o accionistes, i de l'interès públic, i inclou mesures per evitar els conflictes d'interès.

La política de compensació total està orientada a impulsar comportaments que assegurin la creació de valor a llarg termini i la sostenibilitat dels resultats en el temps.

En general, la proporció de la remuneració variable pel que fa a la remuneració fixa anual és relativament reduïda. La proporció del component fix de la remuneració permet aplicar una política flexible de remuneració variable, que inclou la possibilitat, en els casos que preveu la política, de no abonar cap quantitat de remuneració variable en un exercici determinat.

En cas que els professionals que facin funcions de control tinguin remuneració variable, els seus objectius no han d'incloure reptes de negoci des del punt individual, de l'àrea o de les IIC gestionades, a fi d'assegurar la seva independència respecte de les àrees que supervisen.

Es prohibeix als professionals de CaixaBank AM fer servir estratègies personals de cobertura i assegurament de les seves remuneracions o de les obligacions que hi estan relacionades, amb la finalitat de deteriorar l'alineació amb el perfil de risc implícit en aquesta estructura de remuneració.

La remuneració variable per als professionals de CaixaBank AM està orientada a esperar comportaments que assegurin la generació de valor a llarg termini i la sostenibilitat dels resultats en el temps, i es basa en la combinació de remuneració (proporcionalitat entre remuneració fixa i variable, descrita més amunt) i en el mesurament de l'execució. En cap cas la remuneració variable no estarà vinculada solament i directament a decisions individuals de gestió o criteris que incentivin l'assumpció de riscos incompatible amb el perfil de risc de l'entitat o les seves normes en matèria de conducta o conflictes d'interessos, les IIC que gestiona i els seus participants.

La determinació de la remuneració variable, es basa en una combinació del mesurament de l'acompliment individual, de l'àrea, unitat de negoci o IIC concernides (en la mesura en què sigui aplicable), tenint en compte criteris quantitius (financers) i qualitius (no financers) fixats en l'àmbit de l'entitat, d'àrea o individualment segons el que sigui procedent.

Així mateix, el pagament de la remuneració variable no es duu a terme per mitjà de vehicles o mètodes que puguin facilitar l'elusió de les normes contingudes en la política.

El grup d'empleats que pertanyen a l'Àrea d'Inversions disposa d'un pla de remuneració variable o programa de bonus específic, que incorpora una combinació de reptes o indicadors relacionats, d'una banda, amb els resultats de l'empresa i, de l'altra, amb els resultats de les IIC gestionades, tant des del punt de vista individual com de departament i l'àrea.

Per als empleats de la resta d'àrees, a més dels indicadors relacionats amb els resultats de l'empresa, el seu programa de remuneració variable incorpora un seguit de reptes que es fixen mitjançant un acord de cada professional amb el seu responsable funcional, i que han de ser coincidents amb els reptes de l'àrea a què pertany i amb els globals de la companyia.

Als membres del col·lectiu identificat, l'activitat dels quals pot tenir una incidència significativa sobre el perfil de risc de la gestora o de les IIC que gestionen, s'hi aplicarà addicionalment la política de compensació específica que preveu que la remuneració variable es farà per mitjà d'instruments financers i que estarà sotmesa a ajornament.

Durant l'exercici 2021 s'ha modificat la política de remuneracions, amb la finalitat d'actualitzar les facultats que el Comitè de Nomenaments i Remuneracions té atribuïdes en matèria de remuneració. Així mateix, s'ha adaptat al Reglament 2019/ 2088 sobre divulgació d'informació relativa a la sostenibilitat en el sector dels serveis financers, i ha recollit la possibilitat d'aplicar la direcció de la companyia un factor corrector en la prima resultant a final de cada any.

La revisió feta durant aquest exercici ha posat de manifest que tant la seva aplicació com la determinació del col·lectiu identificat i el disseny de la política compleixen els requeriments reguladors vigents.

## **11. INFORMACIÓ SOBRE LES OPERACIONS DE FINANÇAMENT DE VALORS, REUTILITZACIÓ DE LES GARANTIES I SWAPS DE RENDIMENT TOTAL (REGLAMENT UE 2015/2365)**

Apartat 11: Informació sobre les operacions de finançament de valors, reutilització de les garanties i permutes financeres de rendiment total (Reglament UE 2015/2365).

1) Dades globals:

a) Import dels valors i matèries primeres en préstec.

N/A.

b) Import en actius compromesos de tipus OFV:

En la data de la fi de període hi ha adquisicions temporals d'actius per import de 31.999.801,81 €, que representa 1,77 % sobre els actius gestionats per la IIC.

2) Dades relatives la concentració:

a) Emissor de la garantia real de les OFV que s'han fet:

Tresor públic.

b) Contrapart de cada tipus d'OFV:

CaixaBank, SA.

3) Dades de transacció agregades corresponents a cada tipus d'OFV i de permutes de rendiment total, que es desglossaran de manera separada d'acord amb les categories següents:

a) Tipus i qualitat de la garantia:

N/A.

b) Venciment de la garantia:

N/A.

c) Moneda de la garantia:

N/A.

d) Venciment de les OFV:

Entre un dia i una setmana.

e) País en què s'hagin establert les contraparts:

Espanya.

f) Liquidació i compensació:

Entitat de contrapartida central.

4) Dades sobre reutilització de les garanties:

a) Tant per cent de la garantia real rebuda que es reutilitza:

N/A.

b) Rendiment per la institució d'inversió col·lectiva de la reinversió de la garantia en efectiu:

N/A.

5) Custòdia de les garanties reals rebudes per la IIC:

N/A.

6) Custòdia de les garanties reals concedides per la IIC:

N/A.

7) Dades sobre el rendiment i cost:

N/A.