CAIXABANK RF DURACION NEGATIVA, FI

Informe Segundo semestre 2022

Nº Registro CNMV: *5109*
Fecha de registro: *20/01/2017*
Gestora: *CaixaBank Asset Management SGIIC, S.A.*
Depositario: *CECABANK SA*
Grupo Gestora/Depositario: */ CECA*
Rating Depositario: *BBB+*
Auditor: *PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDITORES, S.L.*

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

La Entidad Gestora atenderá las consultas de los clientes, relacionadas con las IIC gestionadas en Pº de la Castellana 51, 5ª pl. 28046 Madrid, correo electrónico a través de formulario disponible en www.caixabank.es

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

1. POLÍTICA DE INVERSIÓN Y DIVISA DE DENOMINACIÓN

CATEGORÍA: Tipo de fondo: Otros; Vocación inversora: Renta fija euro; Perfil riesgo: 7 en una escala del 1 al 7
DESCRIPCIÓN GENERAL: Invierte en activos de renta fija pública y privada, negociados principalmente en zona Euro, pudiendo también ser mercados emergentes.
OPERATIVA EN INSTRUMENTOS DERIVADOS: La exposición global a derivados se medirá con el VaR absoluto, medida de riesgo que referenciado a una probabilidad y un horizonte temporal, indica la pérdida que puede exceder una cartera de inversiones. Se utilizará un VaR máximo de 20% a 1 mes, lo que supone una pérdida máxima estimada (99% de confianza) del 20% mensual. La metodología aplicada para calcular la exposición total al riesgo es VaR absoluto. Una información más detallada sobre la política de inversión del fondo se puede encontrar en su folleto informativo.
DIVISA DE DENOMINACIÓN: EUR

2. DATOS ECONÓMICOS

2.1. DATOS GENERALES

	Periodo Actual	Periodo Anterior	Año actual	Año anterior
Índice de rotación de la cartera	0,00	0,00	0,00	0,00
Rentabilidad media de la liquidez (% anualizado)	1,82	-0,02	0,90	-0,21

Nota: El período se refiere al trimestre o semestre, según sea el caso. En el caso de IIC cuyo valor liquidativo no se determine diariamente, los datos se refieren al último disponible.

CAIXABANK RF DURACION NEGATIVA, FI CLASE PLUS

	Periodo actual	Periodo anterior	Fecha	Patrimonio (miles de euros)	Valor liquidativo (euros)	Comisiones aplicadas en el período, sobre patrimonio medio	% efectivamente cobrado		Base de cálculo
							Periodo	Acumulada	
Nº de participaciones	981.236,16	1.184.466,72	Período	5.597	5,7036	Comisión de gestión	0,42	0,83	Patrimonio
Nº de partícipes	95	110	2021	2.826	5,3318	Comisión de resultados	0,00	0,00	Resultados
Benef. brutos distrib. por particip. (Euros)	0,00	0,00	2020	4.396	5,3663	Comisión de gestión total	0,42	0,83	Mixta
			2019	12.886	5,5083	Comisión de depositario	0,04	0,08	Patrimonio
						Inversión mínima: 150000 EUR			

CAIXABANK RF DURACION NEGATIVA, FI CLASE EXTRA

	Periodo actual	Periodo anterior	Fecha	Patrimonio (miles de euros)	Valor liquidativo (euros)	Comisiones aplicadas en el período, sobre patrimonio medio	% efectivamente cobrado		Base de cálculo
							Periodo	Acumulada	
Nº de participaciones	1.090.829,22	1.609.276,80	Período	6.277	5,7547	Comisión de gestión	0,34	0,67	Patrimonio
Nº de partícipes	29	36	2021	6.860	5,3714	Comisión de resultados	0,00	0,00	Resultados
Benef. brutos distrib. por particip. (Euros)	0,00	0,00	2020	7.562	5,3981	Comisión de gestión total	0,34	0,67	Mixta
			2019	17.574	5,5326	Comisión de depositario	0,04	0,07	Patrimonio
						Inversión mínima: 50000 EUR			

CAIXABANK RF DURACION NEGATIVA, FI CLASE CARTERA

	Periodo actual	Periodo anterior	Fecha	Patrimonio (miles de euros)	Valor liquidativo (euros)	Comisiones aplicadas en el período, sobre patrimonio medio	% efectivamente cobrado		Base de cálculo
							Periodo	Acumulada	
Nº de participaciones	1.990.878,02	5.873.869,22	Período	12.047	6,0511	Comisión de gestión	0,13	0,25	Patrimonio
Nº de partícipes	84	177	2021	36.754	5,6210	Comisión de resultados	0,00	0,00	Resultados
Benef. brutos distrib. por particip. (Euros)	0,00	0,00	2020	223	5,6221	Comisión de gestión total	0,13	0,25	Mixta
			2019	3.480	5,7343	Comisión de depositario	0,01	0,02	Patrimonio
						Inversión mínima:			

2.2. COMPORTAMIENTO

2.2.1. Individual - CAIXABANK RF DURACION NEGATIVA, FI. Divisa EUR

Rentabilidad (% sin anualizar)

CAIXABANK RF DURACION NEGATIVA, FI CLASE PLUS

	Acumulado año actual	Trimestral				Anual			
		31-12-22	30-09-22	30-06-22	31-03-22	2021	2020	2019	2017
Rentabilidad	6,97	0,84	2,34	1,59	2,05	-0,64	-2,58	-2,73	

	Trimestre actual		Último año		Últimos 3 años	
Rentabilidad extremas*	%	Fecha	%	Fecha	%	Fecha
Rentabilidad mínima (%)	-0,74	10-11-22	-0,74	10-11-22	2,34	20-03-20
Rentabilidad máxima (%)	0,43	05-10-22	0,59	13-06-22	0,47	18-03-20

CAIXABANK RF DURACION NEGATIVA, FI CLASE EXTRA

	Acumulado año actual	Trimestral				Anual			
		31-12-22	30-09-22	30-06-22	31-03-22	2021	2020	2019	2017
Rentabilidad	7,14	0,87	2,37	1,63	2,09	-0,50	-2,43	-2,58	

	Trimestre actual		Último año		Últimos 3 años	
Rentabilidad extremas*	%	Fecha	%	Fecha	%	Fecha
Rentabilidad mínima (%)	-0,74	10-11-22	-0,74	10-11-22	2,37	20-03-20
Rentabilidad máxima (%)	0,44	05-10-22	0,59	13-06-22	0,47	18-03-20

CAIXABANK RF DURACION NEGATIVA, FI CLASE CARTERA

	Acumulado año actual	Trimestral				Anual			
		31-12-22	30-09-22	30-06-22	31-03-22	2021	2020	2019	2017
Rentabilidad	7,65	1,00	2,50	1,74	2,21	-0,02	-1,96	-2,12	

	Trimestre actual		Último año		Últimos 3 años	
Rentabilidad extremas*	%	Fecha	%	Fecha	%	Fecha
Rentabilidad mínima (%)	-0,74	10-11-22	-0,74	10-11-22	2,50	20-03-20
Rentabilidad máxima (%)	0,44	05-10-22	0,59	13-06-22	0,47	18-03-20

* Sólo se informa para las clases con una antigüedad mínima del periodo solicitado y siempre que no se haya modificado su vocación inversora.
Se refiere a las rentabilidades máximas y mínimas entre dos valores liquidativos consecutivos.
La periodicidad de cálculo del valor liquidativo es diaria.

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

Medidas de riesgo (%)

	Acumulado año actual	Trimestral				Anual			
Volatilidad * de:		31-12-22	30-09-22	30-06-22	31-03-22	2021	2020	2019	2017
Ibex-35 Net TR	19,30	15,21	16,39	19,91	24,93	16,23	34,19	12,40	
Letra Tesoro 1 año	0,07	0,02	0,03	0,03	0,02	0,02	0,43	0,25	
63% ICE BofA EUR LIBOR O/N Offered Rate (LEC0) + 100% ICE BofA Euro Treasury Bill (EGB0) + -47% ICE BofA 1-10y Euro Govt (EG05) + -13% ICE BofA 1-10y US Treasury (G5O2) + -3% ICE BofA 7-10y UK Gilt (G4L0)	3,30	3,40	3,57	3,49	2,74	1,16	1,44	1,17	

CAIXABANK RF DURACION NEGATIVA, FI CLASE PLUS

	Acumulado año actual	Trimestral				Anual			
Volatilidad * de:		31-12-22	30-09-22	30-06-22	31-03-22	2021	2020	2019	2017
Valor Liquidativo	3,68	3,84	4,07	3,78	2,97	1,17	1,43	1,27	
VaR histórico **	1,22	1,22	1,22	0,88	0,88	0,94	0,95	0,95	

CAIXABANK RF DURACION NEGATIVA, FI CLASE EXTRA

	Acumulado año actual	Trimestral				Anual			
Volatilidad * de:		31-12-22	30-09-22	30-06-22	31-03-22	2021	2020	2019	2017
Valor Liquidativo	3,68	3,84	4,07	3,78	2,97	1,17	1,43	1,27	
VaR histórico **	1,21	1,21	1,21	0,87	0,87	0,93	0,94	0,94	

CAIXABANK RF DURACION NEGATIVA, FI CLASE CARTERA

	Acumulado año actual	Trimestral				Anual			
Volatilidad * de:		31-12-22	30-09-22	30-06-22	31-03-22	2021	2020	2019	2017
Valor Liquidativo	3,68	3,84	4,07	3,78	2,97	1,17	1,43	1,27	
VaR histórico **	1,17	1,17	1,17	0,83	0,83	0,83	0,84	0,81	

* Volatilidad histórica: Indica el riesgo de un valor en un periodo, a mayor volatilidad mayor riesgo. A modo comparativo se ofrece la volatilidad de distintas referencias. Sólo se informa de la volatilidad para los períodos con política de inversión homogénea.
** VaR histórico: Indica lo máximo que se puede perder, con un nivel de confianza del 99%, en el plazo de 1 mes, si se repitiese el comportamiento de la IIC de los últimos 5 años. El dato es a finales del periodo de referencia.

Gastos (% s/ patrimonio medio)

CAIXABANK RF DURACION NEGATIVA, FI

	Acumulado año actual	Trimestral				Anual			
Ratio total de gastos *		31-12-22	30-09-22	30-06-22	31-03-22	2021	2020	2019	2017
CLASE PLUS	0,95	0,23	0,23	0,24	0,23	0,95	0,96	0,92	0,93
CLASE EXTRA	0,80	0,20	0,20	0,21	0,20	0,80	0,81	0,77	0,78
CLASE CARTERA	0,32	0,08	0,07	0,09	0,08	0,32	0,33	0,29	0,24

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

Evolución del valor liquidativo últimos 5 años

Rentabilidad semestral de los últimos 5 años

CAIXABANK RF DURACION NEGATIVA, FI CLASE PLUS

Gráfico evolución valor liquidativo últimos 5 años

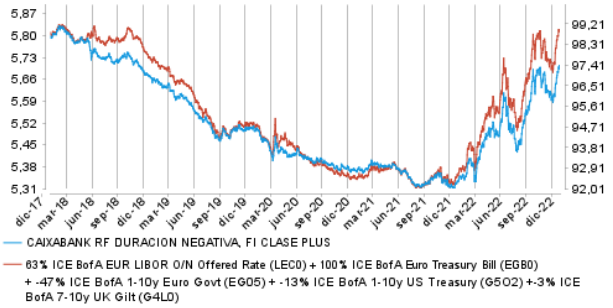
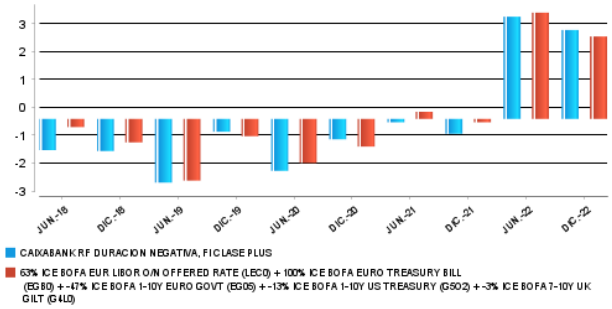


Gráfico rentabilidad semestral de los últimos 5 años



CAIXABANK RF DURACION NEGATIVA, FI CLASE EXTRA

Gráfico evolución valor liquidativo últimos 5 años

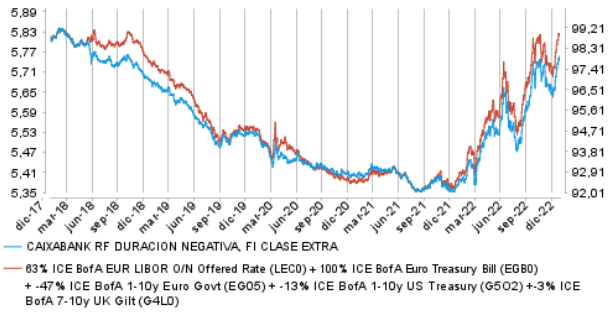
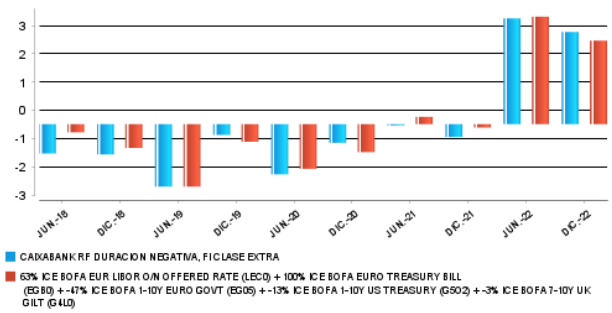


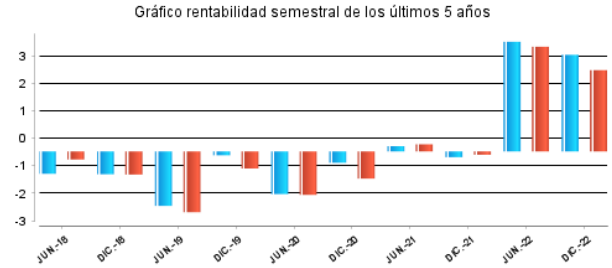
Gráfico rentabilidad semestral de los últimos 5 años



CAIXABANK RF DURACION NEGATIVA, FI CLASE CARTERA

Gráfico evolución valor liquidativo últimos 5 años

Gráfico rentabilidad semestral de los últimos 5 años



2.2.2. Comparativa

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

Vocación inversora	Patrimonio gestionado* (miles de euros)	Nº de partícipes*	Rentabilidad semestral media**
Renta Fija euro	20.995.852	1.830.808	-3,02
Renta Fija Internacional	2.881.948	628.188	-4,49
Renta Fija Mixta Euro	2.290.240	83.514	-2,46
Renta Fija Mixta Internacional	6.256.052	197.253	-1,18
Renta Variable Mixta Euro	85.832	5.042	2,54
Renta Variable Mixta Internacional	2.817.134	107.832	-2,36
Renta Variable Euro	603.167	280.561	2,76
Renta Variable Internacional	14.968.061	2.197.252	0,15
IIC de gestión Pasiva (I)	0	0	0,00
Garantizado de Rendimiento Fijo	327.832	13.103	-2,45
Garantizado de Rendimiento Variable	676.993	32.968	-1,12
De Garantía Parcial	0	0	0,00
Retorno Absoluto	3.350.917	442.070	0,19
Global	7.372.564	253.439	-1,03
FMM a corto plazo de valor liquidativo variable	0	0	0,00
FMM a corto plazo de valor liquidativo constante de deuda publica	0	0	0,00
FMM a corto plazo de valor liquidativo de baja volatilidad	0	0	0,00
FMM estándar de valor liquidativo variable	4.506.933	99.522	-0,07
Renta fija euro corto plazo	4.183.965	506.107	-0,15
IIC que replica un índice	1.019.761	20.401	4,22
IIC con objetivo concreto de rentabilidad no garantizado	1.038.651	40.359	0,12
Total Fondo	**73.375.902**	**6.738.419**	**-1,32**

*Medias.
(I): Incluye IIC que replican o reproducen un índice, fondos cotizados (ETF) e IIC con objetivo concreto de rentabilidad no garantizado.
**Rentabilidad media ponderada por patrimonio medio de cada FI en el periodo

2.3. DISTRIBUCIÓN DEL PATRIMONIO AL CIERRE DEL PERIODO (IMPORTES EN MILES DE EUROS)

	Fin período actual		Fin período anterior	
Distribución del patrimonio	**Importe**	**% sobre patrimonio**	**Importe**	**% sobre patrimonio**
(+) INVERSIONES FINANCIERAS	21.163	88,47	44.953.693	90,18
* Cartera interior	16.634	69,54	31.280.181	62,75
* Cartera exterior	4.473	18,70	13.706.451	27,50
* Intereses cartera inversión	55	0,23	-32.940	-0,07
* Inversiones dudosas, morosas o en litigio	0	0,00	0	0,00
(+) LIQUIDEZ (TESORERÍA)	2.442	10,21	4.378.996	8,78
(+/-) RESTO	317	1,32	516.913	1,04
TOTAL PATRIMONIO	**23.921**	**100,00**	**49.849.601**	**100,00**

Notas:
El período se refiere al trimestre o semestre, según sea el caso.
Las inversiones financieras se informan a valor estimado de realización.

2.4. ESTADO DE VARIACIÓN PATRIMONIAL

	% sobre patrimonio medio			
	Variación del período actual	**Variación del período anterior**	**Variación acumulada anual**	**% Variación respecto fin período anterior**
PATRIMONIO FIN PERIODO ANTERIOR (miles de euros)	49.849.601	46.440.258	46.440.258	
± Suscripciones/ reembolsos (neto)	-61,70	4,97	-56,38	-1.327,29
Beneficios brutos distribuidos	0,00	0,00	0,00	0,00
± Rendimientos netos	3,13	2,65	5,76	16,80
(+) Rendimientos de gestión	3,37	2,89	6,26	0,00
+ Intereses	0,16	-0,23	-0,07	-169,28
+ Dividendos	0,00	0,00	0,00	0,00
± Resultados en renta fija (realizadas o no)	-0,10	-0,03	-0,14	207,71
± Resultados en renta variable (realizadas o no)	0,00	0,00	0,00	0,00
± Resultado en depósitos (realizadas o no)	0,00	0,00	0,00	0,00
± Resultado en derivados (realizadas o no)	3,41	3,09	6,50	9,24
± Resultado en IIC (realizados o no)	-0,01	-0,04	-0,05	-82,51
± Otros Resultados	-0,09	0,10	0,02	-183,34
± Otros rendimientos	0,00	0,00	0,00	0,00
(-) Gastos repercutidos	-0,24	-0,24	-0,50	-0,74
- Comisión de gestión	-0,20	-0,19	-0,40	4,35
- Comisión de depositario	-0,02	-0,02	-0,04	3,37
- Gastos por servicios exteriores	-0,01	-0,03	-0,04	-60,11
- Otros gastos de gestión corriente	0,00	0,00	0,00	-52,17
- Otros gastos repercutidos	-0,01	0,00	-0,02	191,25
(+) Ingresos	0,00	0,00	0,00	0,00
+ Comisiones de descuento a favor de la IIC	0,00	0,00	0,00	0,00
+ Comisiones retrocedidas	0,00	0,00	0,00	0,00
+ Otros ingresos	0,00	0,00	0,00	0,00
PATRIMONIO FIN PERIODO ACTUAL (miles de euros)	23.920.974	49.849.601	23.920.974	

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

3. INVERSIONES FINANCIERAS

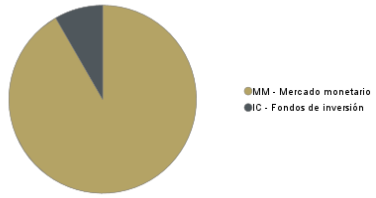
3.1. INVERSIONES FINANCIERAS A VALOR ESTIMADO DE REALIZACIÓN (EN MILES DE EUROS) AL CIERRE DEL PERÍODO

		Período actual		Período anterior	
Descripción de la inversión y emisor	**Divisa**	**Valor de mercado**	**%**	**Valor de mercado**	**%**
LETRAS|TESORO PUBLICO|-0,582|2022-07-08	EUR	0	0,00	100	0,20
LETRAS|TESORO PUBLICO|-0,596|2022-08-12	EUR	0	0,00	2.207	4,43
LETRAS|TESORO PUBLICO|-0,546|2022-09-09	EUR	0	0,00	5.008	10,05
LETRAS|TESORO PUBLICO|-0,508|2022-10-07	EUR	0	0,00	4.207	8,44
LETRAS|TESORO PUBLICO|0,900|2023-04-14	EUR	2.479	10,36	997	2,00
LETRAS|TESORO PUBLICO|1,084|2023-05-12	EUR	3.461	14,47	996	2,00
LETRAS|TESORO PUBLICO|2,154|2023-09-08	EUR	2.934	12,26	0	0,00
TOTAL DEUDA PÚBLICA MENOS DE UN AÑO		**8.874**	**37,09**	**13.516**	**27,12**
TOTAL RENTA FIJA		**8.874**	**37,09**	**13.516**	**27,12**
REPO|TESORO PUBLICO|1,51|2023-01-02	EUR	6.000	25,08	13.000	26,08
TOTAL RENTA FIJA ADQUISICIÓN TEMPORAL ACTIVOS		**6.000**	**25,08**	**13.000**	**26,08**
TOTAL RENTA FIJA		**14.874**	**62,17**	**26.516**	**53,20**
FONDO|CAIXABANK AM	EUR	1.761	7,36	4.764	9,56
TOTAL IIC		**1.761**	**7,36**	**4.764**	**9,56**
TOTAL INTERIOR		**16.634**	**69,53**	**31.280**	**62,76**
LETRAS|ITALY|-0,551|2022-07-14	EUR	0	0,00	701	1,41
LETRAS|ITALY|-0,454|2022-09-14	EUR	0	0,00	4.104	8,23
LETRAS|ITALY|-0,545|2022-10-14	EUR	0	0,00	5.115	10,26
LETRAS|ITALY|-0,491|2022-12-14	EUR	0	0,00	3.000	6,02
LETRAS|ITALY|1,330|2023-05-12	EUR	2.472	10,33	996	2,00
LETRAS|ITALY|2,285|2023-09-14	EUR	1.953	8,16	0	0,00
TOTAL DEUDA PÚBLICA MENOS DE UN AÑO		**4.424**	**18,49**	**13.916**	**27,92**
TOTAL RENTA FIJA		**4.424**	**18,49**	**13.916**	**27,92**
TOTAL RENTA FIJA		**4.424**	**18,49**	**13.916**	**27,92**
TOTAL EXTERIOR		**4.424**	**18,49**	**13.916**	**27,92**
TOTAL INVERSION FINANCIERA		**21.059**	**88,02**	**45.197**	**90,68**

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

3.2. DISTRIBUCIÓN DE LAS INVERSIONES FINANCIERAS, AL CIERRE DEL PERÍODO (% SOBRE EL PATRIMONIO TOTAL)

TIPO DE ACTIVO



3.3. OPERATIVA EN DERIVADOS

RESUMEN DE LAS POSICIONES ABIERTAS AL CIERRE DEL PERÍODO (IMPORTES EN MILES DE EUROS)

	Instrumento	Importe nominal comprometido	Objetivo de la inversión
Total Operativa Derivados Derechos		**0**	
Bn.us Treasury N/b 2.625% 31.0	FUTURO|Bn.us Treasury N/b 2.625% 31.0	1.554	Inversión
Bn.gobierno Aleman 2.2% 12.12.	FUTURO|Bn.gobierno Aleman 2.2% 12.12.	3.526	Inversión
Bn.uk Treasury 4.5% 07.09.34	FUTURO|Bn.uk Treasury 4.5% 07.09.34	611	Inversión
Bn.buoni Poliennali del Tes 4.	FUTURO|Bn.buoni Poliennali del Tes 4.|1000|FÍSICA	462	Inversión
Bn.gobierno Frances 2% 25.11.3	FUTURO|Bn.gobierno Frances 2% 25.11.3	815	Inversión
Bn.bundesobligation 1.3% 15.10	FUTURO|Bn.bundesobligation 1.3% 15.10	4.912	Inversión
Bn.bundesrepub. Deutschland 1.	FUTURO|Bn.bundesrepub. Deutschland 1.	1.690	Inversión
Bn.us Treasury N/b 4.25% 31.12	FUTURO|Bn.us Treasury N/b 4.25% 31.12	1.575	Inversión
Bn.us Treasury N/b 4.125% 15.1	FUTURO|Bn.us Treasury N/b 4.125% 15.1	562	Inversión
Bn.buoni Poliennali del Tes 1.	FUTURO|Bn.buoni Poliennali del Tes 1.|1000|FÍSICA	107	Inversión
Total Operativa Derivados Obligaciones Renta Fija		15.814	
EUR/USD	FUTURO|EUR/USD|125000|	378	Cobertura
Total Operativa Derivados Obligaciones Tipo Cambio		378	
Total Operativa Derivados Obligaciones		**16.192**	

4. HECHOS RELEVANTES

	Si	No
a.Suspensión Temporal de suscripciones / reembolsos		X
b.Reanudación de suscripciones / reembolsos		X
c.Reembolso de patrimonio significativo	X	
d.Endeudamiento superior al 5% del patrimonio	X	
e.Sustitución de la sociedad gestora		X
f.Sustitución de la entidad depositaria		X
g.Cambio de control de la sociedad gestora		X
h.Cambio en elementos esenciales del folleto informativo		X
i.Autorización del proceso de fusión		X
j.Otros Hechos Relevantes		X

5. ANEXO EXPLICATIVO DE HECHOS RELEVANTES

C) Caixabank Asset Management SGIIC, SAU, como Entidad Gestora de dicho Fondo, comunica a la Comisión Nacional del Mercado de Valores que a fecha 2 de diciembre de 2022 el patrimonio del Fondo ha disminuido en un porcentaje superior al 20%, pasando de 31.163.378,94 euros a 21.042.323,78 euros, lo que supone una disminución del 32,63%.
D) CaixaBank Asset Management SGIIC, SAU, como Entidad Gestora de dicho Fondo, comunica que el día 9 de noviembre de 2022 se produjo un descubierto en cuenta que se tradujo en un endeudamiento superior al 5% del patrimonio del mismo, situándose en el 12,55% en el día mencionado. La situación quedó regularizada el 10 de noviembre de 2022.
CaixaBank Asset Management SGIIC, SAU, como Entidad Gestora de dicho Fondo, comunica que el día 2 de diciembre de 2022 se produjo un descubierto en cuenta que se tradujo en un endeudamiento superior al 5% del patrimonio del mismo, situándose en el 7,24% en el día mencionado. La situación quedó regularizada el 5 de diciembre de 2022.

6. OPERACIONES VINCULADAS Y OTRAS INFORMACIONES

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

7. ANEXO EXPLICATIVO SOBRE OPERACIONES VINCULADAS Y OTRAS INFORMACIONES

f) El importe total de las adquisiciones en el período es 1.342.010.018,00 EUR. La media de las operaciones de adquisición del período respecto al patrimonio medio representa un 16,57 %.
h) Se han realizado operaciones de adquisición temporal de activos con pacto de recompra con el depositario, compra/venta de IIC propias y otras por un importe en valor absoluto de 5.000.721,26 EUR. La media de este tipo de operaciones en el período respecto al patrimonio medio representa un 0,06 %.

8. INFORMACIÓN Y ADVERTENCIAS A INSTANCIA DE LA CNMV

No aplicable

9. ANEXO EXPLICATIVO DEL INFORME PERIÓDICO

1. SITUACIÓN DE LOS MERCADOS Y EVOLUCIÓN DEL FONDO.
a) Visión de la gestora/sociedad sobre la situación de los mercados
Cerramos un semestre y un año 2022 complicadísimos en términos de gestión de activos y donde los cambios producidos a nivel económico, geopolítico o de expectativas han marcado el paso de unos mercados financieros convulsos. El comportamiento de algunas clases de activos rompen registros históricos como, por ejemplo, la evolución de la renta fija y los tipos de interés, la apreciación del dólar o incluso la volatilidad en algunas materias primas como el gas natural. Pero si hay dos palabras que hayan definido el año y este segundo semestre, esas son guerra e inflación.El año comenzó de forma razonable con unas expectativas de crecimiento saludables tras la salida de la pandemia. Los bancos centrales continuaban con la idea de que el repunte inflacionista era transitorio y que la política monetaria continuaría de forma acomodaticia. Dos aspectos subyacían el escenario central y que nadie tuvo en cuenta en esos primeros compases: el exceso de liquidez fruto de las políticas fiscales para paliar los efectos de la pandemia, especialmente en EEUU, y la magnitud de las interrupciones en las cadenas de suministro. Estos dos hitos provocaron presión sobre la inflación por encima del consenso esperado por los distintos agentes económicos. Se le añadió a este hito el inicio de la guerra de Ucrania el día 24 de febrero. Este evento acabo de desestabilizar los mercados financieros en una doble vertiente: el incremento desorbitado de los precios de las materias primas, especialmente el gas natural y el petróleo, pero también la incertidumbre generada en la eurozona por el potencial impacto que el conflicto bélico pudiera tener sobre el crecimiento económico, la inflación, y las expectativas en Europa. El impacto geopolítico tampoco se quedó ceñido a la guerra ucraniana, sino que también en este segundo semestre del año hemos asistido al congreso del partido comunista chino que ha reforzado el poder de Xi-Jinping, las turbulencias políticas y económicas en Reino Unido o las elecciones de mitad de mandato en EEUU entre otros eventos con menor impacto como las elecciones en Italia.Como decimos, gran parte de estos eventos han impactado significativamente en una variable que hacía años que no era fuente de preocupación como es la inflación. El repunte inflacionista que empezó siéndolo en su medición general y que luego poco a poco ha ido calando en su medición subyacente (sin el precio de la energía y los alimentos) ha sido de una magnitud que no se veía desde los años 70 tras la crisis del petróleo. Esto ha hecho cambiar el paso de manera dramática a los bancos centrales ya que existía el riesgo cierto de que empezaran a encontrarse por detrás de los acontecimientos. La Reserva Federal subió ha subido los tipos en EEUU en 450 puntos básicos desde la banda del 0%-0,25% a la banda del 4,25%-4,5% siendo la mayor subida de los tipos de interés en América desde hace 4 décadas. El endurecimiento monetario ha sido generalizado, el 90% de los Bancos Centrales ha subido tipos a lo largo del año. En la Eurozona, tras una tímida aproximación en el control de la inflación, el BCE ha cerrado el año siendo el Banco Central con un mensaje más halcón teniendo en cuenta que el origen inflacionista en la Eurozona es totalmente distinto al origen de esta en EEUU. Así en América la escalada de precios es puramente de demanda y cuellos de botella mientras que en Europa se debe a un shock energético y a una crisis de oferta donde la capacidad de la política monetaria es más limitada. El Banco Central Europeo ha subido los tipos en Europa en 250 puntos básicos a lo largo del 2022 desde el 0% pero su comienzo de subidas se retrasó hasta bien entrado el mes de Julio por lo tanto todos los movimientos se han producido en el segundo semestre. Por el lado económico, tanto el shock energético como la inflación y la actuación de los bancos centrales se han cobrado su peaje en forma de ralentización económica. Aun así, la tan cacareada recesión no ha terminado de producirse y parece que se retrasa al 2023. Los indicadores adelantados, como el ISM, han ido gradualmente señalando la desaceleración. El mercado laboral ha mantenido su fortaleza, siendo uno de los principales focos de atención por parte de la Reserva Federal, ya que el crecimiento de los salarios y una tasa de desempleo cercana al pleno empleo no han permitido un control más ágil de la inflación. A pesar de ello, ya en los últimos compases del año, se ha empezado a vislumbrar un recorte en el crecimiento de los precios. Dos factores han influido aquí: las bases comparables mensuales año contra año y la caída de los precios energéticos debido a una menor demanda y a un clima más benigno sobre todo después de verano. En Europa el patrón ha sido similar y las encuestas de actividad alemanas medidas por el ZEW han corregido desde 51,7 a -23,3. En el caso de la tasa de desempleo incluso ha corregido desde un 7% a un 6,5%.Por lo que respecta a otras áreas geográficas, quizás haya sido China la fuente de mayor volatilidad e incertidumbre debido a que ha sido la economía a nivel global con una mayor ralentización agudizada por la política de Covid cero aplicada a lo largo de todo el año 2022. Su potencial reapertura durante el segundo semestre ha sembrado cierta esperanza en los mercados, aunque con las reservas que conlleva la poca información que se tiene por parte de ese país en cuanto a la evolución de casos y variantes del virus.Y como no, la evolución de la guerra ucraniana que ha marcado el paso de los precios energéticos y que tras el verano y los prometedores avances del ejército de Ucrania ha infundido la esperanza de una pronta finalización de esta. A pesar de ello parece que una solución dialogada se encuentra todavía lejos del escenario central y cruzamos el cierre de año con las noticias procedentes de esa área sin novedades muy relevantes.Bajo este entorno los mercados han tenido un año de correcciones generalizadas en todas las clases de activos, pero en algunas de ellas el movimiento ha sido dramático como es el caso de la renta fija. Los inversores en general no habían asistido a una corrección en precio de los bonos y a un repunte de los tipos de semejante magnitud en varias décadas. Si analizamos el comportamiento de los bonos, el tesoro americano ha corregido en el año un -12,5% y la renta fija corporativa un -16%. El High Yield americano ha corregido en 2022 un -11%. En el caso europeo los bonos gubernamentales han corregido entre un -18% y un -22%. El crédito corporativo europeo un -15%. Además, la volatilidad asociada a todas estas correcciones en renta Fija no se había visto en años. Si atendemos al alcance de estas correcciones, las caídas en las bolsas se han quedado minimizadas a pesar de que por ejemplo el SP500 ha corregido en 2022 un -19,44%. En el caso europeo el Eurostoxx 50 ha caído un -11,74%, el NIKKEI 225 japones un -9,37% o el índice chino de Shanghai un -15,13%. En materias primas el año ha sido de subidas generalizadas en prácticamente todas ellas destacando las energéticas como el petróleo con subidas de entre el 25% y el 35% dependiendo del tipo de barril o el gas natural. En divisas el triunfador ha sido el dólar como activo refugio. Su apreciación ha sido de un 5,85% frente al euro y de un 13,94% frente al yen.
b)Decisiones generales de inversión adoptadas.
En términos de duración durante el segundo semestre del año hemos mantenido un posicionamiento en el entorno de -2.40 / -3.15 años. Hemos intentado gestionar la duración de manera activa , modulándola en función de nuestra visión del mercado. Durante el semestre hemos mantenido mayores posiciones vendidas que el índice de referencia en los tramos cortos (2 y 5años) que en el tramo de 10 años tanto en la curva alemana como en la usa. En el resto de las jurisdicciones presente en el índice del fondo pero con un menor peso (Reino Unido, Francia e Italia) hemos mantenido durante el periodo posiciones cercanas a la neutralidad . La parte de contado en el fondo ha estado invertida en en letras del tesoro italiano y español , e incorporamos letras de la Union Europea con vencimiento diciembre 22. Mantenemos en cartera un fondo moneratio (Caixabank Rendimiento) y repos sobre deuda publica a dia
c)Índice de referencia.
La gestión toma como referencia la rentabilidad del índice compuesta por la rentabilidad del 100%BofA ML Euro Tesoro Letras más una posición vendida para dar lugar a una duración negativa de la cartera de -2,50 años con referencia a los índices -47%BofA ML Euro 1-10 años, -13%BofA ML EEUU 1-10 años y -3%BofA ML U.K. 7-10 años, junto a la posición compradora de +63%BofA ML ECO Rate Index dichos índices únicamente a efectos informativos o comparativos.
d)Evolución del Patrimonio, partícipes, rentabilidad y gastos de la IIC.
El patrimonio del fondo al cierre del periodo de referencia ha disminuido en la clase Plus un 14,5% , en la clase Cartera lo ha hecho en un 65% y en la clase Extra un 30%. El número de partícipes se ha reducido en un 13,6% en la clase Plus,un 52,5% en la clase Cartera y un 19,4% en la clase extra.Los gastos directos soportados por clase plus del fondo durante el periodo de referencia han sido del 0,46% , los de la clase extra 0,40% y los de la clase cartera 0,15% .La rentabilidad del fondo durante el segundo semestre del año ha sido de 3,19% en la clase plus , en la clase extra 3,27% y de 3,52% en clase cartera mientras que la de su índice de referencia ha sido del 2,96%.
e)Rendimiento del fondo en comparación con el resto de fondos de la gestora.
La rentabilidad del fondo ha sido superior a la media de los fondos con la misma vocación inversora de la gestora que ha sido del - 3,02%.
2. INFORMACION SOBRE LAS INVERSIONES.
a) Inversiones concretas realizadas durante el periodo.
Destacamos durante el segundo semestre del año la operativa en futuros sobre bonos soberanos europeos y americanos en sus vencimientos de septiembre , diciembre 2022 y marzo 2023, entre los que destacamos por el lado de la curva soberana alemana los futuros soberanos 10 años (RXH3) , 5 años (OEH3) y 2 años(DUH3) El plazo en el que hemos concentrado mayor operativa ha sido el 2 años (DUZ2, DUH3) Por el lado de USA destacamos también los futuros de 2 años (TUH3), 5 años(FVH3) y 10 años (UXYH3).En menor medida operamos también sobre futuro OATs de 10 años frances , italianos en 2 y 10 años (BTSs e IKs) y en el 10 años UK..G Z2,H3 .En la parte contado destacamos la operativa sobre deuda publica a 1 dia, sobre participaciones del fondo monetario Caixabank Monetario Rendimiento ajustando su peso en cartera a las variaciones patrimoniales del fondo y sobre letras a corto plazo. Dentro de los activos con mayor contribución a la rentabilidad del fondo destacamos futuros sobre el soberano aleman a 5 años RXH3 (+1,16%), a 10 años RXH3 (+ 0,58%) y a 2 años DUH3 (0,48%) y con menor contribución a las letras del Tesoro español e italiano septiembre 22 (-0.01% en ambos casos)
b) Operativa de préstamo de valores.
N/A

c) Operativa en derivados y adquisición temporal de activos.
El fondo ha realizado operaciones con instrumentos derivados complementando las posiciones de renta fija para gestionar de un modo más eficaz la cartera. El grado de apalancamiento al final del periodo ha sido del 85,18%.

d) Otra información sobre inversiones.
A la fecha de referencia (31/12/2020) el fondo mantiene una cartera de activos de renta fija con una vida media de 0,32 años y con una TIR media bruta (esto sin descontar los gastos y comisiones imputables al FI) a precios de mercado de 2,24%. Este dato refleja, a la fecha de referencia de la información, la rentabilidad que en términos brutos (calculada como media de las Tasas Internas de Retorno o TIR de los activos de la cartera) obtendría a futuro el FI por el mantenimiento de sus inversiones a vencimiento. La rentabilidad finalmente obtenida por el fondo será distinta al verse afectada, en primer lugar, por los gastos y comisiones imputables a la IIC y como consecuencia de los posibles cambios que pudieran producirse en los activos mantenidos en cartera o la evolución de mercado de los tipos de interés y del crédito de los emisores
La rentabilidad de la liquidez durante el primer trimestre ha sido del 1,82%
3. EVOLUCIÓN DEL OBJETIVO CONCRETO DE RENTABILIDAD.
N/A
4. RIESGO ASUMIDO POR EL FONDO.
La volatilidad acumulada anual ha sido del 3,68 en las tres clases del fondo superior a la de la letra, que ha sido del 0,07% y superior a la de su benchmark que ha sido del 3,30
Dentro de la metodología aplicada para calcular el riesgo de mercado, el VaR parametrico absoluto a 1 mes ha alcanzado nivel 1,79 de minimo, 3,18 de maximo y 2,31 de media durante el periodo utilizando el metodo paramétrico.
5. EJERCICIO DERECHOS POLÍTICOS.
N/A

6. INFORMACIÓN Y ADVERTENCIAS CNMV.
N/A
7. ENTIDADES BENEFICIARIAS DEL FONDO SOLIDARIO E IMPORTE CEDIDO A LAS MISMAS.
N/A
8. COSTES DERIVADOS DEL SERVICIO DE ANÁLISIS.
En Renta Fija, el análisis externo ha ayudado a elaborar expectativas sobre la evolución de los tipos de interés, escenarios y probabilidades necesarias para decidir la duración de las carteras y las preferencias en vencimientos.

En cuanto a la selección de activos de renta fija (asset allocation en bonos), el análisis externo ha completado el interno para definir la ponderación de activos emitidos por entidades públicas respecto a las privadas, la de activos con grado de inversión respecto a "High Yield", la de activos senior respecto a subordinados y las preferencias por sectores y países.

A nivel micro, es muy relevante la aportación de valor de los equipos de análisis de nuestros proveedores externos de research. Los gestores de CaixaBank Asset Management han seleccionado emisores y emisiones apoyándose en las recomendaciones de dichos analistas.

Destacan como proveedores de Renta Fija: Credit Sights, BofA Securities, JP Morgan, BNP Paribas y Barclays Bank, cuya remuneración conjunta supone el 64,74% de los gastos totales.
Los gastos de análisis soportados por la IIC durante el ejercicio 2022 han ascendido a 171,00€ y los gastos previstos para el ejercicio 2023 se estima que serán de 106,65 €.

9. COMPARTIMENTOS DE PROPOSITO ESPECIAL (SIDE POCKETS).
.
N/A
10. PERSPECTIVAS DE MERCADO Y ACTUACION PREVISIBLE DEL FONDO.
En este entorno, nuestra visión de mercados para 2023 no ha sufrido cambios: la prudencia con los datos de inflación es necesaria y máxime con los últimos discursos y actas de los bancos centrales. No se puede dar por acabado este ciclo inflacionista. De hecho, pensamos que la caída en la inflación actualmente se debe a los componentes más volátiles pero que no es extrapolable al resto de la cesta de compra especialmente alquileres y servicios. Es cierto que tanto manufacturas como productos energéticos están ayudando a la moderación en precios, pero será difícil avanzar en llevar los precios a niveles confortables a largo plazo si los salarios no frenan su avance, se enfría algo el mercado laboral americano y tanto los alquileres como lo servicios amortiguan su crecimiento en precio. En este sentido seguimos pensando que el momento para la inversión en renta variable está todavía por llegar ya que en los primeros compases del año 2023 podemos asistir a una revisión de beneficios empresariales que haga corregir a las bolsas de nuevo. Mantenemos un posicionamiento con un mayor foco en sectores defensivos y de calidad. Los cíclicos han rebotado excesivamente para el escenario que se nos plantea para el primer trimestre de 2023.En el caso de la renta fija el escenario es diametralmente distinto. Después de un año 2022 donde la corrección en el precio de los bonos ha sido muy fuerte, no descartamos que tras los últimos discursos de los bancos centrales a cierre de este año hayan puesto encima de la mesa gran parte de toda la "pólvora" restrictiva. De ahí que el siguiente movimiento de compra pueda ser la renta fija gubernamental, para más adelante incorporar el grado de inversión. Los tipos comienzan a ser suficientemente atractivos si consideramos que las expectativas de inflación a largo plazo sigan ancladas, los bancos centrales acaben de hacer bien su trabajo y los tipos de interés terminales a ambos lados del Atlántico queden claros definitivamente.El momento sigue siendo de extremada incertidumbre. Hemos asistido a un año únicos en cuanto a expectativas y movimientos de tipos de interés e inflación se refiere. La posibilidad de que finalmente estemos ante un escenario de recesión técnica se ira viendo en las próximas semanas, pero no en meses. También habrá que estar atentos a dicho flujo de datos e información debido a que los mercados descuentan la coyuntura con plazos desde los seis meses al año y por ello no podemos descartar un giro de los mercados financieros más violento en el plazo de uno o dos trimestres, dependiendo de la profundidad de los desequilibrios y del control de la inflación por parte de los bancos centrales. Por el lado de la gestión del fondo en los próximos meses seguiremos buscando estrategias de inversión que aporten valor al fondo en este escenario en el que es previsible el mantenimiento de una elevada volatilidad de los mercados.

10. INFORMACIÓN SOBRE LA POLÍTICA DE REMUNERACIÓN

1) Datos cuantitativos:

Remuneración total abonada por la SGIIC a su personal desglosada en:

Remuneración Fija: 15.789.445 €
Remuneración Variable: 3.280.726 €

Número de beneficiarios (se especificará el número total de empleados y, dentro de éstos, el número de beneficiarios de remuneración variable).

Número total de empleados: 261
Número de beneficiarios: 242

Remuneración ligada a la comisión de gestión variable de la IIC, indicando que no existe para aquellas IIC que no apliquen este tipo de remuneración.

No existe este tipo de remuneración

Remuneración desglosada en:

Altos cargos: indicando el número de personas incluidas en esta categoría y desglosando en remuneración fija y variable.

Número de personas: 9
Remuneración Fija: 1.467.000 €
Remuneración Variable: 498.900 €

Empleados cuya actuación tenga una incidencia material en el perfil de riesgo de la IIC (en el entendido de que todas las SGIIC cuentan con empleados dentro de este grupo): indicando el número de personas incluidas en esta categoría y desglosando en remuneración fija y variable:

Número de personas: 10
Remuneración Fija: 1.304.889 €
Remuneración Variable: 548.471 €

2) Contenido cualitativo:

La política de remuneración de CaixaBank Asset Management SGIIC, S.A.U (en adelanta ?CaixaBank AM?) constituye un aspecto fundamental de su gobierno corporativo, dada la potencial influencia que las prácticas de remuneración pueden ejercer sobre el perfil de riesgo de la SGIIC y de las IIC que gestiona, así como sobre los potenciales conflictos de interés, todo ello de acuerdo con la normativa sectorial aplicable.

CaixaBank AM como SGIIC y prestadora de servicios de inversión, requiere dotarse de unas políticas adecuadas de remuneración, tanto en relación con los altos directivos, los tomadores de riesgo y las personas que ejerzan funciones de control, como en general con el resto del personal de la Entidad.

En función de lo anterior, CaixaBank AM cuenta con una política de remuneración a sus empleados acorde con una gestión racional y eficaz del riesgo, y la normativa aplicable a las IIC gestionadas. Dicha política es consistente con la estrategia empresarial, los objetivos, los valores y los intereses a largo plazo propios y de las instituciones de inversión colectiva que gestiona, de sus partícipes o accionistas, y del interés público, e incluye medidas para evitar los conflictos de interés.
La política de compensación total está orientada a impulsar comportamientos que aseguren la generación de valor a largo plazo y la sostenibilidad de los resultados en el tiempo.

La proporción de la remuneración variable con respecto a la remuneración fija anual es, en general, relativamente reducida. La proporción del componente fijo de la remuneración permite la aplicación de una política flexible de remuneración variable, que incluye la posibilidad, en los casos previstos en la Política, de no abonar cantidad alguna de remuneración variable en un determinado ejercicio.

En caso de que los profesionales que realicen funciones de control tengan remuneración variable, sus objetivos no deben incluir retos de negocio a nivel individual, del área o de las IIC gestionadas, a fin de asegurar su independencia sobre las áreas que supervisan

Se prohíbe a los profesionales de CaixaBank AM el uso de estrategias personales de cobertura y aseguramiento de sus remuneraciones o de las obligaciones con ellas relacionadas, con la finalidad de menoscabar la alineación con el perfil de riesgo implícito en dicha estructura de remuneración.

La remuneración variable para los profesionales de CaixaBank AM está orientada a impulsar comportamientos que aseguren la generación de valor a largo plazo y a la sostenibilidad de los resultados en el tiempo, y se basa en el mix de remuneración (proporcionalidad entre remuneración fija y variable, anteriormente descrita) y en la medición del desempeño. En ningún caso, la remuneración variable estará vinculada única y directamente a decisiones individuales de gestión o criterios que incentiven la asunción de riesgos incompatible con el perfil de riesgo de la Entidad o sus normas en materia de conducta o conflictos de intereses, las IIC que gestiona y sus partícipes.

La determinación de la remuneración variable se basa en una combinación de la medición del desempeño individual, del área, unidad de negocio o IIC concernidas (en la medida en que sea de aplicación), teniendo en cuenta criterios cuantitativos (financieros) y cualitativos (no financieros) fijados a nivel de la Entidad, de área, o individualmente según proceda.

Asimismo, el pago de la remuneración variable no se efectúa a través de vehículos o métodos que puedan facilitar la elusión de las normas contenidas en la Política.

El grupo de empleados que pertenecen al Área de Inversiones cuenta con un plan de remuneración variable o programa de bonus específico, que incorpora una combinación de retos o indicadores relacionados, por un lado, con los resultados de la empresa y por otro con los resultados de las IIC gestionadas, tanto a nivel individual, como de departamento y el área.

Para los empleados del resto de áreas, además de los indicadores relacionados con los resultados de la empresa, su programa de remuneración variable incorpora una serie de retos que se fijan mediante acuerdo de cada profesional con su responsable funcional, y engloban retos de que deben ser consistentes con los retos del área a la que se pertenece y con los globales de la Compañía.

A aquellos miembros del Colectivo Identificado, cuya actividad puede tener una incidencia significativa sobre el perfil de riesgo de la gestora o de las IIC que gestionan, se les aplicará adicionalmente la policita de compensación especifica que prevé que la remuneración variable se realice a través de instrumentos financieros y que esté sujeta a diferimiento.

Durante el ejercicio 2022 ha habido modificaciones en la política de remuneraciones de la Entidad para incorporar el nuevo modelo de retribución variable del Colectivo Identificado.

La revisión realizada durante dicho ejercicio ha puesto de manifiesto que tanto su aplicación, como la determinación del Colectivo Identificado y el diseño de la política cumplen con los requerimientos regulatorios vigentes.

11. INFORMACIÓN SOBRE LAS OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES, REUTILIZACIÓN DE LAS GARANTÍAS Y SWAPS DE RENDIMIENTO TOTAL (REGLAMENTO UE 2015/2365)

Apartado 11: Información sobre las operaciones de financiación de valores, reutilización de las garantías y swaps de rendimiento total (Reglamento UE 2015/2365).
1)Datos globales:
a)Importe de los valores y materias primas en préstamo.
N/A.
b)Importe en activos comprometidos de tipo OFV:
A fecha fin de periodo hay adquisiciones temporales de activos por importe de 5.999.891,64 € que representa un 28,49% sobre los activos gestionados por la IIC.
2)Datos relativos a la concentración:
a)Emisor de la garantía real de las OFV realizadas:
tesoro publico
b)Contraparte de cada tipo de OFV:
CAIXABANK, SA
3)Datos de transacción agregados correspondientes a cada tipo de OFV y de permutas de rendimiento total, que se desglosarán por separado con arreglo a las categorías siguientes:
a)Tipo y calidad de la garantía:
N/A.
b)Vencimiento de la garantía:
N/A.
c)Moneda de la garantía:
N/A
d)Vencimiento de las OFV:
Entre un día y una semana.
e)País en el que se hayan establecido las contrapartes:
ESPAÑA
f)Liquidación y compensación:
Entidad de contrapartida central.
4)Datos sobre reutilización de las garantías:
a)Porcentaje de la garantía real recibida que se reutiliza:
N/A.
b)Rendimiento para la IIC de la reinversión de la garantía en efectivo:
N/A.
5)Custodia de las garantías reales recibidas por la IIC:
N/A.
6)Custodia de las garantías reales concedidas por la IIC:
N/A.
7)Datos sobre el rendimiento y coste:
N/A.