

# CAIXABANK RF DURACION NEGATIVA, FI

Informe Segundo semestre 2023

Nº Registro CNMV: 5109

Fecha de registro: 20/01/2017

Gestora: CaixaBank Asset Management SGIC, S.A.

Depositario: CECABANK SA

Grupo Gestora/Depositario: CaixaBank SA / 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.caixabankassetmanagement.com](http://www.caixabankassetmanagement.com)

La Entidad Gestora atenderá las consultas de los clientes, relacionadas con las IIC gestionadas en Paseo de la Castellana, 189 Madrid, correo electrónico a través de formulario disponible en [www.caixabank.es](http://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](mailto:inversores@cnmv.es)).

## 1. POLÍTICA DE INVERSIÓN Y DIVISA DE DENOMINACIÓN

**CATEGORÍA:** Tipo de fondo: Otros; Vocación inversora: Renta fija euro; Perfil riesgo: 2 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)	4,21	-0,92	3,47	0,90

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	219.368,76	386.563,13	Período	1.255	5.7206	Comisión de gestión	0,42	0,83	Patrimonio
Nº de partícipes	35	49	2022	5.597	5.7036	Comisión de resultados	0,00	0,00	Resultados
Benef. brutos distrib. por partícip. (Euros)	0,00	0,00	2021	2.826	5.3318	Comisión de gestión total	0,42	0,83	Mixta
			2020	4.396	5.3663	Comisión de depositario	0,04	0,08	Patrimonio

Inversión mínima: 50000 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	26.132,64	206.283,05	Período	151	5.7811	Comisión de gestión	0,34	0,68	Patrimonio
Nº de partícipes	6	11	2022	6.277	5.7547	Comisión de resultados	0,00	0,00	Resultados
Benef. brutos distrib. por partícip. (Euros)	0,00	0,00	2021	6.860	5.3714	Comisión de gestión total	0,34	0,68	Mixta
			2020	7.562	5.3981	Comisión de depositario	0,04	0,08	Patrimonio

Inversión mínima: 150000 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	81.174,49	192.533,98	Período	496	6.1082	Comisión de gestión	0,13	0,25	Patrimonio
Nº de partícipes	3	5	2022	12.047	6.0511	Comisión de resultados	0,00	0,00	Resultados
Benef. brutos distrib. por partícip. (Euros)	0,00	0,00	2021	36.754	5.6210	Comisión de gestión total	0,13	0,25	Mixta
			2020	223	5.6221	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				
		31-12-23	30-09-23	30-06-23	31-03-23	2022	2021	2020	2018
Rentabilidad	0,30	-1,38	1,24	1,31	-0,85	6,97	-0,64	-2,58	-2,25
		Trimestre actual		Último año		Últimos 3 años			
		%	Fecha	%	Fecha	%	Fecha		
Rentabilidad extremas*		-0,31	14-11-23	-0,90	15-03-23	1,24	10-11-22		
Rentabilidad mínima (%)		0,25	29-12-23	0,62	14-03-23	0,59	13-06-22		

**CAIXABANK RF DURACION NEGATIVA, FI CLASE EXTRA**

	Acumulado año actual	Trimestral				Anual			
		31-12-23	30-09-23	30-06-23	31-03-23	2022	2021	2020	2018
Rentabilidad	0,46	-1,34	1,29	1,35	-0,81	7,14	-0,50	-2,43	-2,10
		Trimestre actual		Último año		Últimos 3 años			
<b>Rentabilidad extremas*</b>		%	Fecha	%	Fecha	%	Fecha		
Rentabilidad mínima (%)		-0,31	14-11-23	-0,90	15-03-23	1,29	10-11-22		
Rentabilidad máxima (%)		0,25	29-12-23	0,63	14-03-23	0,59	13-06-22		

**CAIXABANK RF DURACION NEGATIVA, FI CLASE CARTERA**

	Acumulado año actual	Trimestral				Anual			
		31-12-23	30-09-23	30-06-23	31-03-23	2022	2021	2020	2018
Rentabilidad	0,94	-1,23	1,42	1,47	-0,69	7,65	-0,02	-1,96	-1,63
		Trimestre actual		Último año		Últimos 3 años			
<b>Rentabilidad extremas*</b>		%	Fecha	%	Fecha	%	Fecha		
Rentabilidad mínima (%)		-0,31	14-11-23	-0,90	15-03-23	1,42	10-11-22		
Rentabilidad máxima (%)		0,25	29-12-23	0,63	14-03-23	0,59	13-06-22		

\* 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 periodo.

**Medidas de riesgo (%)**

Volatilidad * de:	Acumulado año actual	Trimestral				Anual			
		31-12-23	30-09-23	30-06-23	31-03-23	2022	2021	2020	2018
Ibex-35 Net TR	13,92	12,03	12,10	10,59	19,09	19,30	16,23	34,19	13,66
Letra Tesoro 1 año	0,11	0,12	0,11	0,11	0,10	0,07	0,02	0,43	0,65
63% ICE BofA EUR LIBOR O/N Offered Rate (LECO) + 100% ICE BofA Euro Treasury Bill (EGB0) + - 47% ICE BofA 1-10y Euro Govt (EG05) + -13% ICE BofA 1-10y US Treasury (G502) + -3% ICE BofA 7-10y UK Gilt (G4L0)	2,89	2,35	2,39	2,47	4,04	3,30	1,16	1,44	1,14

**CAIXABANK RF DURACION NEGATIVA, FI CLASE PLUS**

Volatilidad * de:	Acumulado año actual	Trimestral				Anual			
		31-12-23	30-09-23	30-06-23	31-03-23	2022	2021	2020	2018
Valor Liquidativo	3,22	2,13	2,41	2,97	4,77	3,68	1,17	1,43	1,21
VaR histórico **	1,38	1,38	1,38	1,38	1,38	1,22	0,94	0,95	0,96

**CAIXABANK RF DURACION NEGATIVA, FI CLASE EXTRA**

Volatilidad * de:	Acumulado año actual	Trimestral				Anual			
		31-12-23	30-09-23	30-06-23	31-03-23	2022	2021	2020	2018
Valor Liquidativo	3,22	2,13	2,41	2,97	4,77	3,68	1,17	1,43	1,21
VaR histórico **	1,37	1,37	1,37	1,37	1,37	1,21	0,93	0,94	0,95

**CAIXABANK RF DURACION NEGATIVA, FI CLASE CARTERA**

Volatilidad * de:	Acumulado año actual	Trimestral				Anual			
		31-12-23	30-09-23	30-06-23	31-03-23	2022	2021	2020	2018
Valor Liquidativo	3,22	2,13	2,41	2,97	4,77	3,68	1,17	1,43	1,21
VaR histórico **	1,32	1,32	1,32	1,32	1,32	1,17	0,83	0,84	0,76

\* 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 periodos 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.

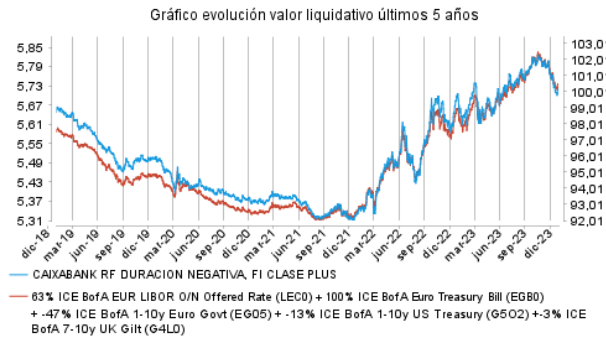
**Gastos (% s/ patrimonio medio)**
**CAIXABANK RF DURACION NEGATIVA, FI**

Ratio total de gastos *	Acumulado año actual	Trimestral				Anual			
		31-12-23	30-09-23	30-06-23	31-03-23	2022	2021	2020	2018
CLASE PLUS	1,04	0,32	0,32	0,26	0,24	0,95	0,95	0,96	0,91
CLASE EXTRA	0,89	0,29	0,29	0,22	0,20	0,80	0,80	0,81	0,76
CLASE CARTERA	0,41	0,17	0,17	0,10	0,08	0,32	0,32	0,33	0,28

\* Incluye los gastos directos soportados en el periodo de referencia: comisión de gestión sobre patrimonio, comisión de depositario, auditoría, servicios bancarios (salvo gastos de financiación), y resto de gastos de gestión corriente, en términos de porcentaje sobre patrimonio medio del periodo. En el caso de fondos/compartimentos que invierten más de un 10% de su patrimonio en otras IIC 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**

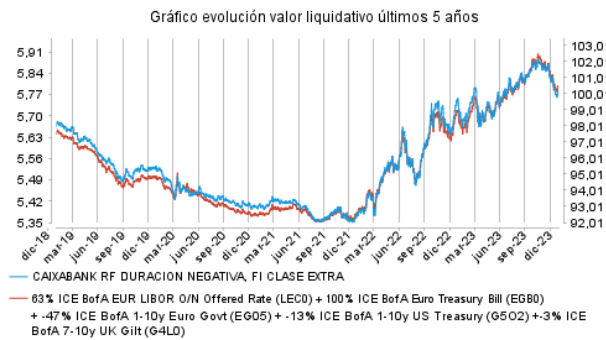
### CAIXABANK RF DURACION NEGATIVA, FI CLASE PLUS



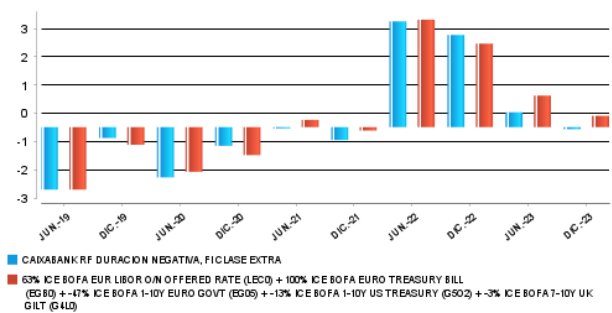
### Gráfico rentabilidad semestral de los últimos 5 años



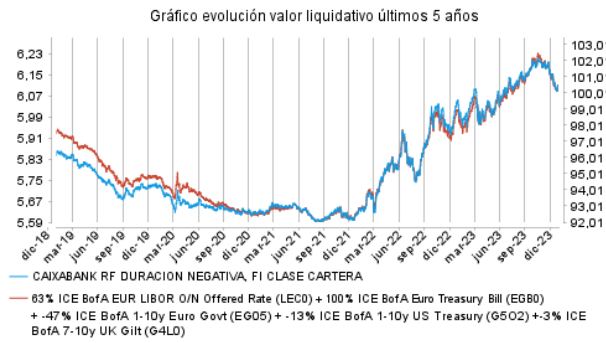
### CAIXABANK RF DURACION NEGATIVA, FI CLASE EXTRA



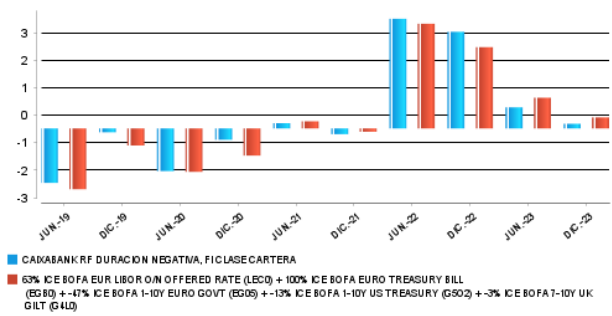
### Gráfico rentabilidad semestral de los últimos 5 años



### CAIXABANK RF DURACION NEGATIVA, FI CLASE CARTERA



### 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 participes*	Rentabilidad semestral media**
Renta Fija euro	30.378.052	1.866.057	3,50
Renta Fija Internacional	4.151.554	641.305	1,93
Renta Fija Mixta Euro	1.678.552	66.414	3,42
Renta Fija Mixta Internacional	4.537.293	157.074	3,33
Renta Variable Mixta Euro	93.248	4.842	3,77
Renta Variable Mixta Internacional	2.086.434	84.330	3,20
Renta Variable Euro	646.282	261.830	5,56
Renta Variable Internacional	14.466.432	2.030.891	5,28
IIC de gestión Pasiva (I)	0	0	0,00
Garantizado de Rendimiento Fijo	295.296	12.202	2,56
Garantizado de Rendimiento Variable	488.866	24.307	2,15
De Garantía Parcial	0	0	0,00
Retorno Absoluto	2.737.834	403.728	2,50
Global	6.491.399	237.773	3,69
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	8.141.543	164.757	1,77
Renta fija euro corto plazo	2.263.956	470.032	1,95
IIC que replica un índice	1.249.129	20.221	6,41
IIC con objetivo concreto de rentabilidad no garantizado	747.905	29.269	1,57
<b>Total Fondo</b>	<b>80.453.776</b>	<b>6.475.032</b>	<b>3,52</b>

\*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)

Distribución del patrimonio	Fin periodo actual		Fin periodo anterior	
	Importe	% sobre patrimonio	Importe	% sobre patrimonio
(+) INVERSIONES FINANCIERAS	1.573	82,72	4.030.110	87,95
* Cartera interior	629	33,08	1.211.876	26,45
* Cartera exterior	928	48,79	2.777.721	60,62
* Intereses cartera inversión	16	0,85	40.513	0,88
* Inversiones dudosas, morosas o en litigio	0	0,00	0	0,00
(+) LIQUIDEZ (TESORERÍA)	314	16,52	501.001	10,93
(+/-) RESTO	14	0,76	51.079	1,11
<b>TOTAL PATRIMONIO</b>	<b>1.902</b>	<b>100,00</b>	<b>4.582.190</b>	<b>100,00</b>

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 periodo actual	Variación del periodo anterior	Variación acumulada anual	% Variación respecto fin periodo anterior
<b>PATRIMONIO FIN PERIODO ANTERIOR (miles de euros)</b>	4.582.190	23.920.973	23.920.974	
± Suscripciones/ reembolsos (neto)	-75,87	-156,24	-276,56	-86,03
Beneficios brutos distribuidos	0,00	0,00	0,00	0,00
± Rendimientos netos	0,44	-0,40	-0,43	-130,80
(+) Rendimientos de gestión	0,98	-0,08	0,32	0,00
+ Intereses	1,38	0,93	2,06	-57,45
+ Dividendos	0,00	0,00	0,00	0,00
± Resultados en renta fija (realizadas o no)	0,14	-0,04	0,01	-213,07
± 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)	-0,67	-1,09	-2,00	-82,33
± Resultado en IIC (realizados o no)	0,18	0,10	0,23	-46,44
± Otros Resultados	-0,05	0,02	0,02	-155,25
± Otros rendimientos	0,00	0,00	0,00	0,00
(-) Gastos repercutidos	-0,54	-0,32	-0,75	-51,40
- Comisión de gestión	-0,32	-0,26	-0,56	-64,65
- Comisión de depositario	-0,03	-0,03	-0,05	-64,79
- Gastos por servicios exteriores	-0,15	-0,03	-0,12	29,06
- Otros gastos de gestión corriente	-0,04	0,00	-0,02	1.777,62
- Otros gastos repercutidos	0,00	0,00	0,00	-99,97
(+) 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
<b>PATRIMONIO FIN PERIODO ACTUAL (miles de euros)</b>	<b>1.901.824</b>	<b>4.582.190</b>	<b>1.901.824</b>	

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

## 3. INVERSIONES FINANCIERAS

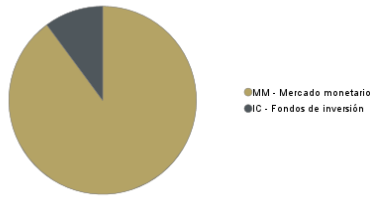
### 3.1. INVERSIONES FINANCIERAS A VALOR ESTIMADO DE REALIZACIÓN (EN MILES DE EUROS) AL CIERRE DEL PERÍODO

Descripción de la inversión y emisor	Divisa	Periodo actual		Periodo anterior	
		Valor de mercado	%	Valor de mercado	%
LETRAS TESORO PUBLICO 2,379 2023-09-08	EUR	0	0,00	539	11,76
<b>TOTAL DEUDA PÚBLICA MENOS DE UN AÑO</b>		<b>0</b>	<b>0,00</b>	<b>539</b>	<b>11,76</b>
<b>TOTAL RENTA FIJA</b>		<b>0</b>	<b>0,00</b>	<b>539</b>	<b>11,76</b>
REPO TESORO PUBLICO 3,77 2024-01-02	EUR	470	24,71	0	0,00
REPO TESORO PUBLICO 3,43 2023-07-03	EUR	0	0,00	300	6,55
<b>TOTAL RENTA FIJA ADQUISICIÓN TEMPORAL ACTIVOS</b>		<b>470</b>	<b>24,71</b>	<b>300</b>	<b>6,55</b>
<b>TOTAL RENTA FIJA</b>		<b>470</b>	<b>24,71</b>	<b>839</b>	<b>18,31</b>
FONDO CAIXABANK AM	EUR	159	8,37	373	8,13
<b>TOTAL IIC</b>		<b>159</b>	<b>8,37</b>	<b>373</b>	<b>8,13</b>
<b>TOTAL INTERIOR</b>		<b>629</b>	<b>33,08</b>	<b>1.212</b>	<b>26,44</b>
LETRAS DEUTSCHLAND 3,086 2024-02-21	EUR	480	25,26	774	16,90
LETRAS FRECH TREASURY 3,096 2023-11-29	EUR	0	0,00	975	21,28
LETRAS FRECH TREASURY 3,774 2024-02-14	EUR	50	2,61	0	0,00
LETRAS FRECH TREASURY 3,713 2024-02-28	EUR	50	2,61	0	0,00
LETRAS ITALY 2,551 2023-09-14	EUR	0	0,00	1.028	22,43
LETRAS ITALY 3,978 2024-07-12	EUR	97	5,11	0	0,00
LETRAS ITALY 3,977 2024-01-31	EUR	197	10,37	0	0,00
LETRAS ITALY 3,753 2024-03-28	EUR	49	2,60	0	0,00
<b>TOTAL DEUDA PÚBLICA MENOS DE UN AÑO</b>		<b>923</b>	<b>48,56</b>	<b>2.777</b>	<b>60,61</b>
<b>TOTAL RENTA FIJA</b>		<b>923</b>	<b>48,56</b>	<b>2.777</b>	<b>60,61</b>
<b>TOTAL RENTA FIJA</b>		<b>923</b>	<b>48,56</b>	<b>2.777</b>	<b>60,61</b>
<b>TOTAL EXTERIOR</b>		<b>923</b>	<b>48,56</b>	<b>2.777</b>	<b>60,61</b>
<b>TOTAL INVERSION FINANCIERA</b>		<b>1.553</b>	<b>81,64</b>	<b>3.989</b>	<b>87,05</b>

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	
<b>Total Operativa Derivados Derechos</b>	<b>0</b>		
Bn.buoni Poliennali del Tes 3.	FUTURO Bn.buoni Poliennali del Tes 3. 1000 FÍSICA	106	Inversión
Bn.bundesschatzanweisungen 3.1	FUTURO Bn.bundesschatzanweisungen 3.1	212	Inversión
Bn.uk Treasury 4.25% 07.03.36	FUTURO Bn.uk Treasury 4.25% 07.03.36	118	Inversión
Bn.bundesobligation 2.4% 19.10	FUTURO Bn.bundesobligation 2.4% 19.10	351	Inversión
Bn.bundesrepub. Deutschland 2.	FUTURO Bn.bundesrepub. Deutschland 2.	265	Inversión
Total Operativa Derivados Obligaciones Renta Fija		1.051	
<b>Total Operativa Derivados Obligaciones</b>		<b>1.051</b>	

### 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 21 de diciembre de 2023 el patrimonio del Fondo ha disminuido en un porcentaje superior al 20%, pasando de 2.501.790,83 euros a 1.999.462,52 euros, lo que supone una disminución del 20,05%.

I) Autorizar, a solicitud de CAIXABANK ASSET MANAGEMENT SGIIC, S.A., como entidad Gestora, y de CECABANK, S.A., como entidad Depositaria, la fusión por absorción de CAIXABANK VALOR 97/50 EUROSTOXX 2, FI (inscrito en el correspondiente registro de la CNMV con el número 4915), CAIXABANK RENDIMIENTO GARANTIZADO 2023 III, FI (inscrito en el correspondiente registro de la CNMV con el número 4987), CAIXABANK RENDIMIENTO GARANTIZADO 2023 IV, FI (inscrito en el correspondiente registro de la CNMV con el número 5001), CAIXABANK RF DURACION NEGATIVA, FI (inscrito en el correspondiente registro de la CNMV con el número 5109), CAIXABANK GARANTIZADO RENTAS 15, FI (inscrito en el correspondiente registro de la CNMV con el número 5025), CAIXABANK RENDIMIENTO GARANTIZADO 2023 V, FI (inscrito en el correspondiente registro de la CNMV con el número 5009), por CAIXABANK INTERES 5, FI (inscrito en el correspondiente registro de la CNMV con el número 5677).

### 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 éstos ha actuado como colocador, asegurador, director o asesor, o se han prestado valores a entidades vinculadas		X
f.Se han adquirido valores o instrumentos financieros cuya contrapartida ha sido 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

d.2) El importe total de las ventas en el período es 63.178,05 EUR. La media de las operaciones de venta del período respecto al patrimonio medio representa un 0,01 %.

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 680.721,26 EUR. La media de este tipo de operaciones en el período respecto al patrimonio medio representa un 0,10 %.

### 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.

El segundo semestre del año 2023 ha estado marcado por la evolución de la inflación y la actitud de los bancos centrales respecto a la misma. Por otro lado, el debate sobre un aterrizaje suave o duro de la economía norteamericana se ha situado también en el centro de los análisis de los inversores. Sin embargo, la reapertura de China, los estímulos fiscales en Estados Unidos y Europa y la sorprendente fortaleza de los consumidores estadounidenses, estabilizaron el crecimiento a lo largo del semestre y para el conjunto del año. El optimismo adicional del mercado en relación con la inteligencia artificial, los medicamentos para la reducción de peso o las expectativas de bajadas en los tipos de interés de la Fed, entre otros, han dado lugar a un comportamiento de los activos de riesgo ampliamente positivo especialmente en el cierre del año. Y todo esto ha sido a pesar de haber vivido el ciclo de mayor subida de los tipos de interés en décadas junto con el inicio de una nueva guerra en Gaza que viene a sumarse a la guerra de Ucrania, la crisis energética y la recesión en algunas partes de la eurozona. Volviendo al análisis del crecimiento de Estados Unidos, este se mantuvo fuerte durante todo el semestre. Los elevados déficits fiscales, el sólido mercado laboral y el fuerte ritmo de consumo, respaldaron la economía y el apetito por el riesgo. En este sentido los mercados no se preocuparon por la sostenibilidad de la deuda norteamericana ni por acontecimientos como la rebaja de la calificación de la deuda estadounidense a principios del verano. Hay que destacar también que gran parte de la rentabilidad positiva del SP500 este semestre se debe a un muy reducido número de acciones ("las 7 magníficas") que han subido, entre otros motivos, debido al calor de la Inteligencia Artificial. Los bancos centrales y su política monetaria, para lograr el control de la inflación, han acaparado gran parte del foco en el 2023 y también durante el segundo semestre. El Core IPC mundial aceleró su caída de forma más significativa especialmente después del verano en gran parte por la desaceleración de los precios de los bienes manufacturados mientras que, por el contrario, los precios de los servicios mantenían una mayor rigidez. En paralelo, los indicadores adelantados - oferta laboral, productividad, exceso de capacidad productiva, ... - han ido señalando un entorno de menor inflación. Añadido a esto, el efecto de las políticas de endurecimiento monetario, aunque con un mayor retardo que el esperado, contribuían a desacelerar el crecimiento de los precios. Esto permitía que tanto la Reserva Federal, el BCE como el Banco de Inglaterra, a partir del tercer trimestre han ido señalado una pausa o incluso fin, del ciclo de endurecimiento monetario. En resumen, un PIB nominal que creció un 1,5%, por encima de lo previsto, y una inflación que ha corregido desde máximos, dejaba al sector privado en mejor situación de lo que en un primer momento se descontaba para el año que ha finalizado, aunque con grandes divergencias, como la europea frente a la americana. Durante el segundo semestre de 2023 también hemos tenido una gran influencia por parte de los eventos geopolíticos. La negociación del techo de deuda en EEUU fue un evento que llevo al límite las negociaciones dando lugar incluso a la rebaja del rating de la deuda norteamericana por parte de Fitch desde AAA a AA+, con un acuerdo llegando en el último instante. Desde el punto de vista geoestratégico la guerra de Ucrania ha continuado afectando a los precios de las materias primas, donde comienza a observarse un efecto de "desdolarización" en favor de otras divisas. También hemos asistido en el último trimestre del 2023 al nuevo conflicto entre Hamas e Israel de consecuencias todavía inciertas a cierre de año. Pasando a analizar el semestre desde el punto de vista de los mercados financieros cabe destacar que esta etapa ha sido una de las mejores desde el punto de vista de rentabilidad de las bolsas mundiales desde el 2019 sobre todo por el buen comportamiento de los dos últimos meses del año y no tanto por el periodo veraniego, al calor del optimismo respecto a las posibles bajadas de tipos de interés por parte de la Reserva Federal y a la potencial influencia en las cuentas de resultados empresariales de la inteligencia artificial. Es en la parte final del semestre, y especialmente durante los meses de noviembre y diciembre, cuando los datos de inflación junto con los mensajes de los bancos centrales desataron la euforia generalizada. El mercado de renta fija se ha estado debatiendo entre la recesión, el aterrizaje suave y "no aterrizaje" de la economía americana, como termómetro de las potenciales decisiones por parte de los bancos centrales ante una inflación que, aunque desaceleraba, ha estado en niveles incómodos a lo largo del semestre, especialmente durante el periodo estival. Todo esto ha llevado a una segunda parte del año muy turbulenta para la renta fija. Los tipos de interés del bono del tesoro americano a 10 años comenzaron a repuntar desde el mes de Julio hasta finales de octubre pasando desde Tires del 3,80% al 5% por los mejores datos económicos en EEUU, una mayor resiliencia de la inflación y la posibilidad de que los tipos de interés se mantuvieran "altos por más tiempo". El giro desde comienzo de noviembre, con la evidencia de la caída significativa de la inflación, renovaron las esperanzas de bajadas de tipos. De esta forma el vaivén en la rentabilidad del bono americano ha pasado de un 5% en octubre a cerrar el año en un 3,88% algo por encima de donde comenzó en enero de 2023. A pesar de esta volatilidad el índice Bloomberg US Treasury ha tenido un comportamiento en el semestre de +2,43% del que un +5,7% se atesora sólo en el cuarto trimestre y un espectacular 3,4% sólo en diciembre. Prácticamente vemos el mismo dibujo de comportamiento en la Eurozona, con un crecimiento debilitado pero una inflación en niveles elevados. En el caso europeo, el índice Bloomberg Paneuropeo agregado ha subido un +5,37%. El crédito corporativo a ambos lados del Atlántico también ha subido del orden de un +5,15% en EEUU y un 6,48% en Europa. El mayor apetito por el riesgo a finales de año también ha supuesto un gran comportamiento para el High Yield con un cierre de semestre para el índice Ige High Yield global de +7,69%. Desde el lado del fondo, durante las primeras semanas del periodo con una economía americana que seguía sin acusar el efecto de la fuerte subida de tipos habida, con unas negociaciones sobre el límite de deuda en Usa, cuyo acuerdo si bien significaría una relajación de las tensiones también supondría un incremento fuerte de emisión de letras del tesoro americano para volver a recargar la cuenta del tesoro... nos llevo a un enfoque de cautela en términos de duración, con niveles inferiores a su índice de referencia. Mas adelante con el cambio comentado referido a unas mejores lecturas de inflación (mas moderadas) en las ultimas semanas del año junto a mensajes de los banqueros centrales apuntando hacia una pausa o incluso posible bajadas de tipos en el futuro, nos llevo a esperar un mejor comportamiento de los bonos y en especial en los plazo cortos (en pasados ciclos de bajadas de tipos de interés los activos a corto plazo con frecuencia tienen mejor comportamiento que aquellos de mayor plazo).

#### b) Decisiones generales de inversión adoptadas.

La cartera del Fondo Duración Negativa se compone por un lado de posiciones en contado donde se invierte la liquidez del fondo y de otro de posiciones cortas (futuros vendidos) sobre una serie de bonos soberanos. Por el lado de contado durante el semestre hemos invertido en letras a corto plazo fundamentalmente de Italia, Francia, Alemania y España, también en participaciones en un fondo monetario (Caixabank Rendimiento Monetario) nunca por encima del 10% del patrimonio y por ultimo en repos sobre deuda publica en plazo de día. Dado lo atractivo del tipo repo en día (actualmente en el 4% área) hemos intentado mantener niveles de inversion en repo cercanos al máximo legal. La gestión de esta parte se ha dirigido fundamentalmente a atender las variaciones patrimoniales habidas durante el semestre. Por el lado de la parte de la cartera con posiciones en futuros vendidos durante el semestre... el mayor posicionamiento se ha centrado en la curva alemana seguida de la estadounidense. ambas con mayor peso en el índice de referencia. En general durante la primera parte del periodo hemos mantenidos mas posiciones vendidas que el índice de referencia en ambas curvas para pasar en las ultimas semanas del semestre cuando aparecían señales que apuntaban a un potencial final del proceso de subidas de tipos por los bancos centrales, a posiciones vendidas mas moderadas que el índice.

#### 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, participes, rentabilidad y gastos de la IIC.

El patrimonio del fondo al cierre del periodo de referencia ha disminuido en la clase Plus un 42,9%, en la clase Cartera lo ha hecho en un 957,62% y en la clase Extra un 87,3%. El número de participes se ha reducido en un 28,6% en la clase Plus, un 40% en la clase Cartera y un 45,5% en la clase Extra. Los gastos totales acumulados en el semestre sobre el patrimonio medio soportados por la clase plus del fondo han sido del 0,65%, los de la clase extra 0,57% y los de la clase cartera 0,33%. La rentabilidad del fondo durante el primer semestre del año ha sido de -0,16% en la clase plus, en la clase extra -0,07% y de 0,17% en clase cartera mientras que la de su índice de referencia ha sido del 0,40%.

#### e) Rendimiento del fondo en comparación con el resto de fondos de la gestora.

La rentabilidad del fondo ha sido inferior a la media de los fondos con la misma vocación inversora de la gestora que ha sido del 3,50%.

### 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 y diciembre 23 y marzo 24 entre los que destacamos por el lado de la curva soberana alemana los futuros soberanos 10 años (RXZ3), 5 años (OEZ3) y 2 años (DUZ3) El plazo en el que hemos concentrado mayor operativa ha sido el 2 años y 5 años. Por el lado de USA destacamos también los futuros de 2 años (TUZ3), 5 años (FVZ3) y 10 años (UXYZ3). En menor medida operamos también sobre futuro OAT de 10 años frances, italianos en 2 y 10 años (BTS e IKS) y en el 10 años UK. G Z3, U4. En la parte contado destacamos la operativa sobre deuda publica a 1 día, 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... letras Tesoro italiano 7/24, letras Tesoro alemán 2/24, letras Tesoro frances 11/23 y la operativa en repos día y con menor contribución, futuro sobre soberano Reino Unido Septiembre y Diciembre 23. Sobre soberano Usa en 2 y 5 años.

#### 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 88,07%.

#### d) Otra información sobre inversiones.

A la fecha de referencia (31/12/2023) el fondo mantiene una cartera de activos de renta fija con una vida media de 0,12 años y con una TIR media bruta (esto sin descontar los gastos y comisiones imputables al FI) a precios de mercado de 3,30%. 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 4,21%

### 3. EVOLUCIÓN DEL OBJETIVO CONCRETO DE RENTABILIDAD.

N/A

#### 4. RIESGO ASUMIDO POR EL FONDO.

La volatilidad acumulada anual ha sido del 3,22 en las tres clases del fondo superior a la de la letra del tesoro a 1 año que ha sido de 0,11

Dentro de la metodología aplicada para calcular el riesgo de mercado, el VaR paramétrico absoluto a 1 mes ha alcanzado nivel 1.52 de mínimo, 2.36 de máximo y 1.90 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, 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 Deutsche Bank, cuya remuneración conjunta supone el 69,26% de los gastos. Los gastos de análisis soportados por la IIC durante el ejercicio 2023 han ascendido a 45,30€ y los gastos previstos para el ejercicio 2024 se estima que serán de 10,14 €.

## 9. COMPARTIMENTOS DE PROPOSITO ESPECIAL (SIDE POCKETS).

N/A

## 10. PERSPECTIVAS DE MERCADO Y ACTUACION PREVISIBLE DEL FONDO.

Entramos en un año 2024 donde, tras el rally de los mercados de 2023, las valoraciones de todas las clases de activos se encuentran en un punto exigente. Para que las bolsas continúen su tendencia alcista parece necesario que el incremento en beneficios empresariales se produzca ya que no parece muy realista una nueva expansión de múltiplos. A su vez el sólido y rápido rebote de las bolsas en el cierre de 2023 limita en cierta medida el momento bursátil para el 2024. El ejercicio seguirá siendo muy táctico. Mientras tanto, mantenemos una posición equilibrada por sectores y estilos, pero reforzando la apuesta por los beneficiarios de un ciclo de crecimiento más prolongado, las empresas del inicio de la cadena de valor industrial (materiales, sobre todo) y las economías emergentes (excepto China). En el caso de la renta fija mantenemos una apuesta clara por la curva y por la dirección. La espectacular caída en las rentabilidades de los bonos ha anticipado el movimiento posible de la Reserva Federal, pero mientras continúe la tendencia de desinflación, el optimismo se puede mantener, por lo que nos reforzamos en la convicción por los tramos más cortos de la curva. Tanto los bonos corporativos como los de la periferia de la Eurozona nos parecen los instrumentos más atractivos para materializar la apuesta. En la asignación de activos, el panorama para el conjunto del año es atractivo para los activos de riesgo: el apoyo de la Reserva Federal y, mientras no se acelere la inflación, las rentabilidades de los activos de riesgo serán potencialmente atractivas y, sobre todo, la capacidad de diversificación de la renta fija que presenta una clara oportunidad para construir carteras eficientes.

Esta prevista la fusión del fondo Duración Negativa con otro fondo (Caixabank Interés 5) en las primeras semanas del año.

## 10. INFORMACIÓN SOBRE LA POLÍTICA DE REMUNERACIÓN

### 1) Datos cuantitativos:

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

Remuneración Fija: 18.283.001 €

Remuneración Variable: 3.071.680 €

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: 273

Número de beneficiarios: 239

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

o Remuneración Fija: 1.667.629 €

o Remuneración Variable: 434.932 €

Empleados cuya actuación tenga una incidencia material en el perfil de riesgo de la IIC (en el entendido de que todas las SGIC 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

o Remuneración Fija: 1.228.603 €

o Remuneración Variable: 480.517 €

?

### 2) Contenido cualitativo:

La política de remuneración de CaixaBank Asset Management SGIC, S.A.U 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 SGIC y de las IIC que gestiona, así como sobre los potenciales conflictos de interés, todo ello de acuerdo con la normativa sectorial aplicable.

CaixaBank Asset Management SGIC, S.A.U. como SGIC 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 ejercen funciones de control, como en general con el resto del personal de la Entidad.

En función de lo anterior, CaixaBank Asset Management SGIC, S.A.U. 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,s 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 política de compensación específica que prevé que la remuneración variable se realice a través de instrumentos financieros y que esté sujeta a diferimiento.

Durante el ejercicio 2023 ha habido modificaciones en la política de remuneraciones de la entidad, con el fin de actualizarla a la normativa aplicable, así como a las recomendaciones establecidas en el plan de auditoría interna de CABK.

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 469.946,49 € que representa un 30,27% 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.