

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

(Société d'Investissement à Capital Variable)

Raport półroczny z nierewidowanymi sprawozdaniami finansowymi za okres od 1 stycznia 2021 do 30 czerwca 2021 roku

RCS Luxembourg B 45 337

Zlecenia nabycia nie mogą być składane w oparciu niniejsze sprawozdania finansowe. Zlecenia nabycia są wiążące wyłącznie, gdy zostały złożone w oparciu o aktualny prospekt i dokumenty Kluczowych Informacji dla Inwestorów („KIID”), uzupełnione sprawozdaniem rocznym za ostatni rok lub najnowszym dostępnym sprawozdaniem półrocznym, jeśli zostało opublikowane po terminie sprawozdania rocznego.

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Spis treści

Dyrektorzy i administracja

Informacje dla posiadaczy Tytułów Uczestnictwa

Skonsolidowane zestawienie aktywów netto na dzień 30 czerwca 2021 roku

Zestawienie aktywów netto na dzień 30 czerwca 2021 roku

Skonsolidowane zestawienie operacji i zmian w aktywach netto funduszu za okres od dnia 1 stycznia 2021 roku do 30 czerwca 2021 roku

Zestawienie operacji i zmian w aktywach netto funduszu za okres od dnia 1 stycznia 2021 roku do 30 czerwca 2021 roku

Dane statystyczne

SANTANDER GO KRÓTKOTERMINOWYCH PAPIERÓW WARTOŚCIOWYCH USD

SANTANDER OBLIGACJI KORPORACYJNYCH AMERYKI ŁACIŃSKIEJ

SANTANDER AM SZANS INWESTYCYJNYCH AKCJI EUROPEJSKICH

SANTANDER GO AKCJI PÓŁNOCNOAMERYKAŃSKICH

SANTANDER EUROPEJSKICH SPÓŁEK DYWIDENDOWYCH

SANTANDER AM OBLIGACJI AMERYKI ŁACIŃSKIEJ

SANTANDER AM EUROPEJSKICH OBLIGACJI KORPORACYJNYCH

SANTANDER AM AKCJI EUROPEJSKICH

SANTANDER AM SZANS INWESTYCYJNYCH AKCJI AMERYKI ŁACIŃSKIEJ

SANTANDER AKTYWNEGO PORTFELA 1

SANTANDER AKTYWNEGO PORTFELA 2

SANTANDER KUPONU OBLIGACJI KORPORACYJNYCH

SANTANDER SELECT DEFENSYWNY

SANTANDER SELECT STABILNY

SANTANDER SELECT DYNAMICZNY

SANTANDER MULTI INDEX SUBSTANCE

SANTANDER MULTI INDEX BALANCE

SANTANDER MULTI INDEX AMBITION

SANTANDER SELECT INCOME

SANTANDER SELECT TOTAL RETURN

SANTANDER GO ABSOLUTE RETURN

SANTANDER GO GLOBALNYCH AKCJI ESG

SANTANDER COVERED BOND

SANTANDER GO DYNAMIC BOND

SANTANDER OBLIGACJI O RATINGU INWESTYCYJNYM ESG AMERYKI ŁACIŃSKIEJ

SANTANDER FUTURE WEALTH

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2021 roku

Inne informacje

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Dyrektorzy i administracja

Siedziba Urzędowa

6, route de Trèves
L-2633 Senningerberg
Luksemburg

Przewodniczący Rady Dyrektorów SICAV

Pan Carlo MONTAGNA
Niezależny Dyrektor

21st Century Building
Luksemburg

Dyrektorzy

Pan Luis CAVERO

Dyrektor Generalny
ALLFUNDS BANK INTERNATIONAL S.A.
Luksemburg

Pan Carlos DIAZ NÚÑEZ Global Head
Produkty Detaliczne i Rozwiązania dla Klientów
Santander Asset Management
Hiszpania

Mr Stefan JOCHUM
CEO
Santander Asset Management S.A., S.G.I.I.C., (German
Branch) Niemcy

Bank Depozytariusz i Agent Płatności, Agent Administracyjny, Rejestrowy, Korporacyjny i Domicylacyjny

J.P. MORGAN BANK LUXEMBOURG S.A. 6, route de
Trèves
L-2633 Senningerberg
Luksemburg

Podmioty Zarządzające Aktywami

SANTANDER ASSET MANAGEMENT S.A., S.G.I.I.C
69, Calle Serrano E-
28006 Madryt
Hiszpania

Dla następujących subfunduszy:
SANTANDER AM SZANS INWESTYCYJNYCH AKCJI EUROPEJSKICH
SANTANDER AM OBLIGACJI AMERYKI ŁACIŃSKIEJ »,
SANTANDER AM EUROPEJSKICH OBLIGACJI KORPORACYJNYCH
SANTANDER EUROPEJSKICH SPÓŁEK DYWIDENDOWYCH
SANTANDER AM AKCJI EUROPEJSKICH
SANTANDER AKTYWNEGO PORTFELA 1
SANTANDER AKTYWNEGO PORTFELA 2
SANTANDER KUPONU OBLIGACJI KORPORACYJNYCH
SANTANDER SELECT INCOME
SANTANDER COVERED BOND
SANTANDER FUTURE WEALTH

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Dyrektorzy i administracja (c.d.)

Podmioty Zarządzające Aktywami (c.d.)

SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT
DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS
S.A.

Av. Pres. Juscelino Kubitschek, 2235 - 18º Andar
Capital do Estado de Sao Paulo
São Paulo
Brazylia

Dla następujących subfunduszy:

SANTANDER AM AKCJI BRAZYLIJSKICH

SANTANDER AM OBLIGACJI BRAZYLIJSKICH (zawieszony od
17 lipca 2020 r.)

SANTANDER BRAZYLIJSKICH KRÓTKOTERMINOWYCH PAPIERÓW
WARTOŚCIOWYCH

SANTANDER ASSET MANAGEMENT UK LIMITED

287, St. Vincent Street
G2 5NB Glasgow, Szkocja
Wielka Brytania

Dla następujących subfunduszy:

SANTANDER OBLIGACJI KORPORACYJNYCH AMERYKI ŁACIŃSKIEJ

SANTANDER AM SZANS INWESTYCYJNYCH AKCJI AMERYKI
ŁACIŃSKIEJ

SANTANDER SELECT DEFENSYWNY

SANTANDER SELECT STABILNY

SANTANDER SELECT DYNAMICZNY

SANTANDER MULTI INDEX BALANCE

SANTANDER MULTI INDEX SUBSTANCE

SANTANDER MULTI INDEX AMBITION

SANTANDER SELECT TOTAL RETURN

SANTANDER OBLIGACJI O RATINGU INWESTYCYJNYM ESG
AMERYKI ŁACIŃSKIEJ

AMUNDI SGR S.p.A.

Via Cernaia 8/10
20121 Mediolan
Włochy

Dla subfunduszu:

SANTANDER GO ABSOLUTE RETURN ».

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Dyrektorzy i administracja (c.d.)

Podmioty Zarządzające Aktywami (c.d.)

ROBECO INSTITUTIONAL ASSET MANAGEMENT B.V.
Weena 850
3014 DA Rotterdam
Netherlands
(od 28 maja 2021 r.)

BOSTON PARTNERS GLOBAL INVESTORS INC
909 Third Avenue
32nd Floor
Nowy Jork
Nowy Jork 10022
USA (do 27 maja 2021 r.)

Dla subfunduszu:
SANTANDER GO GLOBALNYCH AKCJI ESG

JPMORGAN ASSET MANAGEMENT (UK) LIMITED
25 Bank Street,
Canary Wharf
Londyn
E14 5JP
Wielka Brytania

Dla subfunduszu: SANTANDER GO KRÓTKOTERMINOWYCH
PAPIERÓW WARTOŚCIOWYCH USD ».

MORGAN STANLEY INVESTMENT MANAGEMENT LIMITED
25, Cabot Square
Canary Wharf E14
4QA Londyn
Wielka Brytania

Dla subfunduszu SANTANDER GO AKCJI
PÓŁNOCNOAMERYKAŃSKICH

PIMCO DEUTSCHLAND GmbH
Seidlstrasse 24-24a
Monachium
80335
Niemcy

Dla subfunduszu: SANTANDER GO DYNAMIC BOND

Pełnomocnicy

ALLFUNDS BANK S.A.
7, Calle de los Padres Dominicos E-
28050 Madryt
Hiszpania

ALLFUNDS BANK INTERNATIONAL S.A.
30, Boulevard Royal
L-2449 Luksemburg
Luksemburg

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Dyrektorzy i administracja (c.d.)

Audytora

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative
2, rue Gerhard Mercator
B.P. 1443
L-1014 Luksemburg
Luksemburg

Doradca prawny

ELVINGER HOSS PRUSSEN
Société anonyme
2, place Winston Churchill
L-1340 Luksemburg
Luksemburg

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Informacje dla Posiadaczy Tytułów Uczestnictwa

Coroczne Walne Zgromadzenie Posiadaczy Tytułów Uczestnictwa SANTANDER SICAV („SICAV”) odbywa się w urzędowej siedzibie SICAV, lub w innym miejscu w Luksemburgu w ostatni dzień roboczy miesiąca kwietnia każdego roku, o godzinie 15:00, a jeśli dzień ten nie będzie dniem pracy banków w Luksemburgu, zgromadzenie odbędzie się w następnym dniu roboczym dla banków w Luksemburgu przypadającym po tym terminie.

Powiadomienia o wszystkich walnych zgromadzeniach będą wysyłane do każdego zarejestrowanego Posiadacza Tytułów Uczestnictwa pocztą, co najmniej osiem dni przed terminem zgromadzenia, na jego adres podany w rejestrze Posiadaczy Tytułów Uczestnictwa. W powiadomieniu podany zostanie porządek obrad, czas i miejsce zgromadzenia oraz warunki uczestnictwa, a także wymagania dotyczące quorum i większości na zgromadzeniu w świetle prawa obowiązującego w Luksemburgu.

Raporty roczne, z uwzględnieniem rewidowanych sprawozdań finansowych zostaną opublikowane w ciągu czterech miesięcy po zakończeniu każdego roku finansowego, a nierewidowane sprawozdania półroczne zostaną opublikowane w ciągu dwóch miesięcy po zakończeniu odpowiedniego okresu. Sprawozdania takie będą udostępniane w siedzibie SICAV w normalnych godzinach pracy. Rok finansowy SICAV będzie kończyć się w dniu 31 grudnia każdego roku.

Informacje dotyczące wartości aktywów netto (NAV), ceny oferowanej oraz ceny umorzenia można uzyskać w siedzibie urzędowej SICAV.

W świetle aktualnie obowiązującego prawa i praktyki, zarejestrowani Posiadacze Tytułów Uczestnictwa nie podlegają opodatkowaniu jakimkolwiek podatkiem od zysków kapitałowych, podatkiem dochodowym, podatkiem pobieranym u źródła, podatkiem od darowizn, podatkiem spadkowym ani innym podatkiem płatnym w Luksemburgu (za wyjątkiem Posiadaczy Tytułów Uczestnictwa z domicyłem podatkowym, rezydentów lub posiadaczy prawa stałego pobytu w Luksemburgu).

Zaleca się, aby inwestorzy zasięgnęli porady u profesjonalnych doradców w kwestii konsekwencji podatkowych i innych konsekwencji nabycia, posiadania, umorzenia, zamiany, przeniesienia lub zbycia Tytułów Uczestnictwa w świetle prawa obowiązującego w państwie, którego są obywatelami, rezydentami lub posiadaczami domicylu.



SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Skonsolidowane zestawienie aktywów netto na dzień 30 czerwca 2021 roku

	Noty	EUR
AKTYWA		
Inwestycje w papiery wartościowe po cenie rynkowej	3.1	6,250,760,825.55
Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 13	4,142,984.66
Opcje kupione po cenie rynkowej	3.6, 12	6,398,042.33
Swapy total return po cenie rynkowej	3.13, 15	2,228,188.49
Środki pieniężne w banku	3.1	259,181,744.07
Środki pieniężne u brokera	3.1	59,973,782.13
Należności z tytułu sprzedaży papierów wartościowych		101,424,549.20
Należności z subskrypcji		8,749,701.53
Należne odsetki i dywidendy netto	3.10	18,750,375.12
Rozliczenia międzyokresowe kosztów	3.11	286,716.03
Należności z tytułu umów z przyrzeczeniem odkupu	3.12, 16	92,503,583.78
Niezrealizowany zysk netto z kontraktów term. forward	3.4, 10	2,789,008.53
Niezrealizowany zysk z kontraktów futures	3.5, 11	4,130,652.32
Niezrealizowany zysk z kontraktów swap stóp proc.	3.7, 14	3,033,957.66
Inne należności		3,088,361.42
Aktywa ogółem		6,817,442,472.82
PASYWA		
Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 13	4,407,755.76
Wartość rynkowa opcji	3.6, 12	4,026,562.82
Swapy total return po cenie rynkowej	3.13, 15	119,202.64
Kredyt w rachunku bankowym	3.1	2,124,809.36
Kredyt w rachunku brokera	3.1	85,058.49
Zobowiązania z tytułu nabycia papierów wartościowych		193,009,863.82
Zobowiązania z tytułu umorzeń		6,427,366.31
Zobowiązania z tytułu podatków i inne koszty	6	6,663,146.69
Niezrealizowana strata z kontraktów walutowych	3.4, 10	3,560,678.35
Niezrealizowana strata z kontraktów futures	3.5, 11	3,448,262.03
Niezrealizowana strata z kontraktów swap stóp proc.	3.7, 14	2,231,337.82
Inne wymagane płatności		99,381.21
Pasywa ogółem		226,203,425.30
Aktywa netto razem		6,591,239,047.52

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie aktywów netto na dzień 30 czerwca 2021 roku (c.d.)

SANTANDER GO
AKCJI PÓŁNOCNO
AMERYKAŃSKICH

USD

Noty

AKTYWA

Inwestycje w papiery wartościowe po cenie rynkowej	3.1	1,957,349,872.28
Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 13	-
Opcje kupione po cenie rynkowej	3.6, 12	286,970.67
Swapy total return po cenie rynkowej	3.13, 15	-
Środki pieniężne w banku	3.1	50,973,503.93
Środki pieniężne u brokera	3.1	-
Należności z tytułu sprzedaży papierów wartościowych		-
Należności z subskrypcji		566,700.16
Należności z subskrypcji	3.10	3,841,901.70
Rozliczenia międzyokresowe kosztów	3.11	21,425.84
Należności z tytułu umów z przyrzeczeniem odkupu	3.12, 16	-
Niezrealizowany zysk netto z kontraktów term. forward	3.4, 10	14,508.30
Niezrealizowany zysk z kontraktów futures	3.5, 11	-
Niezrealizowany zysk z kontraktów swap stóp procentowych	3.7, 14	-
Inne należności		7,102.00

Aktywa ogółem

2,011,473,897.76

PASYWA

Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 13	-	-
Wartość rynkowa opcji	3.6, 12	-	-
Swapy total return po cenie rynkowej	3.13, 15	-	-
Kredyt w rachunku bankowym	3.1	-	-
Kredyt w rachunku brokera	3.1	0.28	-
Zobowiązania z tytułu nabycia pap. wartościowych		17,860,599.92	-
Zobowiązania z tytułu umorzeń		2,100,615.30	-
Zobowiązania z tytułu podatków i inne koszty	6	1,311,742.70	-
Niezrealizowana strata z kontraktów walutowych	3.4, 10	511,988.84	-
Niezrealizowana strata z kontraktów futures	3.5, 11	-	-
Niezrealizowana strata z kontraktów swap stóp procentowych	3.7, 14	-	-
Inne wymagane płatności		7,395.67	-

Pasywa ogółem

21,792,342.71

Aktywa netto razem

1,989,681,555.05

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie aktywów netto na dzień 30 czerwca 2021 roku (c.d.)

	Liczba wyemitowanych tytułów uczestnictwa	WAN na jeden tytuł uczestnictwa
SANTANDER GO AKCJI PÓŁNOCNOAMERYKAŃSKICH - USD		
Klasa A	1,134,366.57	USD 38.22
Klasa B	7,803,236.20	USD 43.45
Klasa BEH	565,317.43	EUR 176.98
Klasa C	1,235,047.72	USD 19.51
Klasa I	10,692,494.05	USD 19.88
Klasa M	1,714,975.49	USD 195.20
Klasa ME	3,378,744.51	EUR 206.78
Klasa RKP *	50.00	GBP 108.77
Klasa SE	4,321.13	EUR 175.12
Klasa V	466,431.49	USD 188.01

* Zobacz notę 1

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie aktywów netto na dzień 30 czerwca 2021 roku (c.d.)

		SANTANDER AM AKCJI EUROPEJSKICH
	Noty	EUR
AKTYWA		
Inwestycje w papiery wartościowe po cenie rynkowej	3.1	576,572,939.79
Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 13	-
Opcje kupione po cenie rynkowej	3.6, 12	-
Swapy total return po cenie rynkowej	3.13, 15	-
Środki pieniężne w banku	3.1	29,286,952.91
Środki pieniężne u brokera	3.1	5,348,362.74
Należności z tytułu sprzedaży papierów wartościowych		479,931.88
Należności z subskrypcji		437,100.00
Należności z subskrypcji	3.10	657,059.72
Rozliczenia międzyokresowe kosztów	3.11	113,028.81
Należności z tytułu umów z przyrzeczeniem odkupu	3.12, 16	-
Niezrealizowany zysk netto z kontraktów term. forward	3.4, 10	-
Niezrealizowany zysk z kontraktów futures	3.5, 11	-
Niezrealizowany zysk z kontraktów swap stóp procentowych	3.7, 14	-
Inne należności		1,532,933.03
Aktywa ogółem		614,428,308.88
PASYWA		
Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 13	-
Wartość rynkowa opcji	3.6, 12	-
Swapy total return po cenie rynkowej	3.13, 15	-
Kredyt w rachunku bankowym	3.1	-
Kredyt w rachunku brokera	3.1	-
Zobowiązania z tytułu nabycia papierów wartościowych		-
Zobowiązania z tytułu umorzeń		39,524.48
Zobowiązania z tytułu podatków i inne koszty	6	334,048.46
Niezrealizowana strata z kontraktów walutowych	3.4, 10	-
Niezrealizowana strata z kontraktów futures	3.5, 11	62,400.00
Niezrealizowana strata z kontraktów swap stóp procentowych	3.7, 14	-
Inne wymagane płatności		-
Pasywa ogółem		435,972.94
Aktywa netto razem		613,992,335.94

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie aktywów netto na dzień 30 czerwca 2021 roku (c.d.)

	Liczba wyemitowanych tytułów uczestnictwa	Wartość Aktywów Netto per share
SANTANDER AM AKCJI EUROPEJSKICH - EUR		
Klasa A	193,143.30	EUR 193.59
Klasa AU	2,008.36	USD 128.77
Klasa B	18,539.74	EUR 141.07
Klasa I	10,453.47	EUR 1,793.63
Klasa IKP	44,999.48	GBP 2,119.11
Klasa M	3,647,965.50	EUR 121.69

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie aktywów netto na dzień 30 czerwca 2021 roku (c.d.)

		SANTANDER GO GLOBALNYCH AKCJI ESG
	Noty	USD
AKTYWA		
Inwestycje w papiery wartościowe po cenie rynkowej	3.1	337,359,314.19
Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 13	-
Opcje kupione po cenie rynkowej	3.6, 12	-
Swapy total return po cenie rynkowej	3.13, 15	-
Środki pieniężne w banku	3.1	5,045,119.63
Środki pieniężne u brokera	3.1	-
Należności z tytułu sprzedaży papierów wartościowych		5,629,711.57
Należności z subskrypcji		1,515,063.12
Należności z subskrypcji	3.10	195,171.50
Rozliczenia międzyokresowe kosztów	3.11	25,047.23
Należności z tytułu umów z przyrzeczeniem odkupu	3.12, 16	-
Niezrealizowany zysk netto z kontraktów term. forward	3.4, 10	-
Niezrealizowany zysk z kontraktów futures	3.5, 11	-
Niezrealizowany zysk z kontraktów swap stóp procentowych	3.7, 14	-
Inne należności		39,596.90
Aktywa ogółem		349,809,024.14
PASYWA		
Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 13	-
Wartość rynkowa opcji	3.6, 12	-
Swapy total return po cenie rynkowej	3.13, 15	-
Kredyt w rachunku bankowym	3.1	346,057.23
Kredyt w rachunku brokera	3.1	-
Zobowiązania z tytułu nabycia papierów wartościowych		-
Zobowiązania z tytułu umorzeń		89,960.65
Zobowiązania z tytułu podatków i inne koszty	6	233,666.03
Niezrealizowana strata z kontraktów walutowych	3.4, 10	143,402.65
Niezrealizowana strata z kontraktów futures	3.5, 11	-
Niezrealizowana strata z kontraktów swap stóp procentowych	3.7, 14	-
Inne wymagane płatności		19,652.61
Pasywa ogółem		832,739.17
Aktywa netto razem		348,976,248.97

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie aktywów netto na dzień 30 czerwca 2021 roku (c.d.)

	Liczba wyemitowanych tytułów uczestnictwa	WAN na jeden tytuł uczestnictwa
SANTANDER GO GLOBALNYCH AKCJI ESG - USD		
Klasa A	22,770.10	USD 120.09
Klasa AE	159,623.42	EUR 157.89
Klasa B	230,550.88	USD 121.17
Klasa BE	159,034.57	EUR 158.71
Klasa BEH	100,990.65	EUR 118.33
Klasa I	217,363.52	USD 121.38
Klasa IKP	45,000.00	GBP 110.16
Klasa M	1,124,902.93	USD 124.54
Klasa RKP	1,894,403.71	GBP 1.22
Klasa SE *	2,717.36	EUR 103.08
Klasa V	406,328.69	USD 166.05

* Zobacz notę 1

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie aktywów netto na dzień 30 czerwca 2021 roku (c.d.)

	Noty	SANTANDER GO DYNAMIC BOND USD
AKTYWA		
Inwestycje w papiery wartościowe po cenie rynkowej	3.1	242,455,655.52
Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 13	685,317.71
Opcje kupione po cenie rynkowej	3.6, 12	84,074.81
Swapy total return po cenie rynkowej	3.13, 15	-
Środki pieniężne w banku	3.1	2,585,319.39
Środki pieniężne u brokera	3.1	1,553,390.03
Należności z tytułu sprzedaży papierów wartościowych		33,089,985.71
Należności z subskrypcji		96,779.51
Należności z subskrypcji	3.10	894,100.46
Rozliczenia międzyokresowe kosztów	3.11	5,715.94
Należności z tytułu umów z przyrzeczeniem odkupu	3.12, 16	109,700,000.00
Niezrealizowany zysk netto z kontraktów term. forward	3.4, 10	1,496,180.55
Niezrealizowany zysk z kontraktów futures	3.5, 11	99,935.80
Niezrealizowany zysk z kontraktów swap stóp procentowych	3.7, 14	624,455.51
Inne należności		-
Aktywa ogółem		393,370,910.94
PASYWA		
Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 13	
Wartość rynkowa opcji	3.6, 12	146,707.27
Swapy total return po cenie rynkowej	3.13, 15	93,043.06
Kredyt w rachunku bankowym	3.1	-
Kredyt w rachunku brokera	3.1	1,921,872.76
Zobowiązania z tytułu nabycia papierów wartościowych		52,690.82
Zobowiązania z tytułu umorzeń		99,282,450.19
Zobowiązania z tytułu podatków i inne koszty	6	178,898.88
Niezrealizowana strata z kontraktów walutowych	3.4, 10	247,819.26
Niezrealizowana strata z kontraktów futures	3.5, 11	876,918.62
Niezrealizowana strata z kontraktów swap stóp proc.	3.7, 14	912,230.02
Inne wymagane płatności		869,554.06
		12,764.86
Pasywa ogółem		104,594,949.80
		288,775,961.14

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie aktywów netto na dzień 30 czerwca 2021 roku (c.d.)

	Liczba wyemitowanych tytułów uczestnictwa	WAN na jeden tytuł uczestnictwa
SANTANDER GO DYNAMIC BOND - USD		
Klasa A	26,245.96	USD 104.29
Klasa B	588,766.09	USD 104.87
Klasa BEH	319,074.06	EUR 100.31
Klasa I	463,190.00	USD 106.04
Klasa IEH	51,390.86	EUR 100.22
Klasa M	832,093.23	USD 101.33
Klasa MEH	394,649.85	EUR 99.98
Klasa RKP *	53.09	GBP 99.56

* Zobacz notę 1

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie aktywów netto na dzień 30 czerwca 2021 roku (c.d.)

SANTANDER
FUTURE WEALTH *

USD

Noty

AKTYWA

Inwestycje w papiery wartościowe po cenie rynkowej	3.1	147,208,591.79
Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 13	-
Opcje kupione po cenie rynkowej	3.6, 12	150,070.00
Swapy total return po cenie rynkowej	3.13, 15	-
Środki pieniężne w banku	3.1	611,585.30
Środki pieniężne u brokera	3.1	877,226.36
Należności z tytułu sprzedaży papierów wartościowych		13,345,999.32
Należności z subskrypcji		2,904,733.48
Należności z subskrypcji	3.10	(0.00)
Rozliczenia międzyokresowe kosztów	3.11	23,623.10
Należności z tytułu umów z przyrzeczeniem odkupu	3.12, 16	-
Niezrealizowany zysk netto z kontraktów term. forward	3.4, 10	-
Niezrealizowany zysk z kontraktów futures	3.5, 11	70,200.00
Niezrealizowany zysk z kontraktów swap stóp procentowych	3.7, 14	-
Inne należności		-

Aktywa ogółem

165,192,029.35

PASYWA

Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 13	-
Wartość rynkowa opcji	3.6, 12	629,735.00
Swapy total return po cenie rynkowej	3.13, 15	-
Kredyt w rachunku bankowym	3.1	169,843.41
Kredyt w rachunku brokera	3.1	-
Zobowiązania z tytułu nabycia papierów wartościowych		8,284,831.85
Zobowiązania z tytułu umorzeń		556,484.81
Zobowiązania z tytułu podatków i inne koszty	6	186,469.37
Niezrealizowana strata z kontraktów walutowych	3.4, 10	35,019.07
Niezrealizowana strata z kontraktów futures	3.5, 11	-
Niezrealizowana strata z kontraktów swap stóp procentowych	3.7, 14	-
Inne wymagane płatności		6,020.90

Pasywa ogółem

9,868,404.41

Aktywa netto razem

155,323,624.94

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie aktywów netto na dzień 30 czerwca 2021 roku (c.d.)

	Liczba wyemitowanych tytułów uczestnictwa	WAN na jeden tytuł uczestnictwa
SANTANDER FUTURE WEALTH - USD		
Klasa A *	1,259,237.08	USD 102.66
Klasa AE *	81,340.22	EUR 105.33
Klasa M *	21,176.88	USD 102.40
Klasa RKP *	482.02	GBP 102.84
Klasa V *	79,464.41	USD 101.95
Klasa X *	51,295.54	USD 101.74
Klasa XE *	2,568.77	EUR 107.73

* Zobacz notę 1

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Skonsolidowane zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres od 1 stycznia 2021 do 30 czerwca 2021 roku

	Noty	EUR
Wartość Aktywów Netto na początek okresu		5,203,351,500.12
DOCHODY		
Dywidendy netto	3.10	22,322,264.40
Odsetki z tytułu obligacji netto	3.10	20,018,029.82
Odsetki bankowe netto	3.10	2,073.54
Odstępki od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.13	203,179.30
Inne dochody		406,477.59
Dochody ogółem		42,952,024.65
KOSZTY		
Opłaty za zarządzanie	5	22,982,272.69
Opłaty na rzecz depozytariusza	7	504,805.89
Odsetki bankowe netto	3.10	991,060.29
Podatek roczny	8	911,448.23
Amortyzacja wydatków na utworzenie subfunduszy	3.9	3,509.59
Koszty audytu i prawne		196,537.63
Koszty administracyjne	7	1,187,952.10
Inne koszty		1,609,363.85
Koszty ogółem		28,386,950.27
Wynik z inwestycji netto w roku/ okresie		14,565,074.38

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Skonsolidowane zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres od 1 stycznia 2021 do 30 czerwca 2021 roku

	Noty	EUR
Wynik z inwestycji netto w okresie		14,565,074.38
Zrealizowany dochód/strata netto z tytułu:		
- inwestycji	3.2	139,928,533.01
- operacji walutowych	3.3	1,402,146.21
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	48,248.56
- kontraktów futures	3.5	10,825,116.06
- opcji	3.6	1,822,936.75
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.13	946,883.41
Zrealizowany dochód/strata netto za okres		148,523,698.08
Zmiana niezrealizowanego dochodu/straty z tytułu:		
- inwestycji		158,604,418.72
- operacji walutowych	3.3	446,805.04
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	1,210,515.31
- kontraktów futures	3.5	(527,619.32)
- opcji	3.6	(1,723,155.49)
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.13	2,044,220.26
Zmiana niezrealizowanego dochodu/straty w okresie		160,055,184.52
Zysk/(strata) netto z operacji		323,143,956.98
Nabycia	4	1,699,927,927.32
Umorzenia	4	(724,145,492.58)
Wyłacone dywidendy	2	(2,587,317.18)
Przeszacowanie waluty*	3.3	91,548,472.86
Wartość Aktywów Netto na koniec okresu		6,591,239,047.52

* Przeszacowanie waluty wspomniane powyżej wynika z przeliczenia wartości aktywów netto na początku roku (dla subfunduszy denominowanych w walutach innych niż EUR) po kursie obowiązującym na dzień 31 grudnia 2020 roku oraz kursach obowiązujących na dzień 30 czerwca 2021 roku.

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres od 1 stycznia 2021 do 30 czerwca 2021 roku (c.d.)

	Noty	SANTANDER GO AKCJI PÓŁNOCNO AMERYKAŃSKICH USD
Wartość Aktywów Netto na początek okresu		1,439,913,046.80
DOCHODY		
Dywidendy netto	3.10	1,017,591.86
Odsetki z tytułu obligacji netto	3.10	-
Odsetki bankowe netto	3.10	-
Odsetki od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.13	-
Inne dochody		-
Dochody ogółem		1,017,591.86
KOSZTY		
Opłaty za zarządzanie	5	6,045,150.87
Opłaty na rzecz depozytariusza	7	54,717.57
Odsetki bankowe netto	3.10	65,835.25
Podatek roczny	8	175,791.02
Amortyzacja wydatków na utworzenie subfunduszy	3.9	-
Koszty audytu i prawne		3,286.17
Koszty administracyjne	7	286,869.51
Inne koszty		315,525.35
Koszty ogółem		6,947,175.74
Wynik z inwestycji netto w roku/ okresie		(5,929,583.88)

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres od 1 stycznia 2021 do 30 czerwca 2021 roku (c.d.)

	Noty	SANTANDER GO AKCJI PÓŁNOCNO AMERYKAŃSKICH USD
Wynik z inwestycji netto w okresie		(5,929,583.88)
Zrealizowany dochód/strata netto z tytułu:		
- inwestycji	3.2	62,066,881.80
- operacji walutowych	3.3	(729,159.38)
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	720,510.20
- kontraktów futures	3.5	-
- opcji	3.6	(823,760.51)
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.13	-
Zrealizowany dochód/strata netto za okres		61,234,472.11
Zmiana niezrealizowanego dochodu/straty z tytułu:		
- inwestycji		103,624,869.37
- operacji walutowych	3.3	64,260.51
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	565,963.21
- kontraktów futures	3.5	-
- opcji	3.6	(2,768,292.13)
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.13	-
Zmiana niezrealizowanego dochodu/straty w okresie		101,486,800.96
Zysk/(strata) netto z operacji		156,791,689.19
Nabycia	4	598,407,218.61
Umorzenia	4	(205,430,399.55)
Wyłacone dywidendy	2	-
Wartość Aktywów Netto na koniec okresu		1,989,681,555.05

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres od 1 stycznia 2021 do 30 czerwca 2021 roku (c.d.)

	Noty	SANTANDER AM AKCJI EUROPEJSKICH	EUR
Wartość Aktywów Netto na początek okresu		536,288,506.00	
DOCHODY			
Dywidendy netto	3.10	11,586,721.12	
Odsetki z tytułu obligacji netto	3.10	-	
Odsetki bankowe netto	3.10	-	
Odsetki od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.13	-	
Inne dochody		-	
Dochody ogółem		11,586,721.12	
KOSZTY			
Opłaty za zarządzanie	5	635,193.35	
Opłaty na rzecz depozytariusza	7	31,000.28	
Odsetki bankowe netto	3.10	96,796.20	
Podatek roczny	8	35,401.77	
Amortyzacja wydatków na utworzenie subfunduszy	3.9	-	
Koszty audytu i prawne		10,239.97	
Koszty administracyjne	7	104,566.92	
Inne koszty		138,325.97	
Koszty ogółem		1,051,524.46	
Wynik z inwestycji netto w roku/ okresie		10,535,196.66	-

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres od 1 stycznia 2021 do 30 czerwca 2021 roku (c.d.)

	Noty	SANTANDER AM AKCJI EUROPEJSKICH EUR
Wynik z inwestycji netto w okresie		10,535,196.66
Zrealizowany dochód/strata netto z tytułu:		
- inwestycji	3.2	7,387,712.73
- operacji walutowych	3.3	27,103.83
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	-
- kontraktów futures	3.5	155,493.15
- opcji	3.6	-
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.13	-
Zrealizowany dochód/strata netto za okres		7,570,309.71
Zmiana niezrealizowanego dochodu/straty z tytułu:		
- inwestycji		77,718,323.83
- operacji walutowych	3.3	37,408.21
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	-
- kontraktów futures	3.5	(118,693.15)
- opcji	3.6	-
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.13	-
Zmiana niezrealizowanego dochodu/straty w okresie		77,637,038.89
Zysk/(strata) netto z operacji		95,742,545.26
Nabycia	4	27,454,289.63
Umorzenia	4	(45,493,004.95)
Wyłacone dywidendy	2	-
Wartość Aktywów Netto na koniec okresu		613,992,335.94

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres od 1 stycznia 2021 do 30 czerwca 2021 roku (c.d.)

SANTANDER GO
GLOBALNYCH AKCJI ESG
USD

	Noty	
Wartość Aktywów Netto na początek okresu		158,259,748.20
DOCHODY		
Dywidendy netto	3.10	2,197,407.69
Odsetki z tytułu obligacji netto	3.10	-
Odsetki bankowe netto	3.10	-
Odsetki od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.13	-
Inne dochody		-
Dochody ogółem		2,197,407.69
KOSZTY		
Opłaty za zarządzanie	5	767,795.31
Opłaty na rzecz depozytariusza	7	4,638.37
Odsetki bankowe netto	3.10	63,611.08
Podatek roczny	8	22,076.87
Amortyzacja wydatków na utworzenie subfunduszy	3.9	-
Koszty audytu i prawne		7,287.11
Koszty administracyjne	7	51,054.97
Inne koszty		53,167.44
Koszty ogółem		969,631.15
Wynik z inwestycji netto w roku/ okresie		1,227,776.54

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres od 1 stycznia 2021 do 30 czerwca 2021 roku (c.d.)

SANTANDER GO
GLOBALNYCH AKCJI
ESG USD

	Noty	
Wynik z inwestycji netto w okresie		1,227,776.54
Zrealizowany dochód/strata netto z tytułu:		
- inwestycji	3.2	34,006,291.18
- operacji walutowych	3.3	43,054.05
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	3,173,604.13
- kontraktów futures	3.5	-
- opcji	3.6	-
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.13	-
Zrealizowany dochód/strata netto za okres		37,222,949.36
Zmiana niezrealizowanego dochodu/straty z tytułu:		
- inwestycji		(172,639.52)
- operacji walutowych	3.3	(15,937.81)
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	133,583.94
- kontraktów futures	3.5	-
- opcji	3.6	-
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.13	-
Zmiana niezrealizowanego dochodu/straty w okresie		(54,993.39)
Zysk/(strata) netto z operacji		38,395,732.51
Nabycia	4	166,649,976.78
Umorzenia	4	(14,329,172.52)
Wyłączone dywidendy	2	-
Wartość Aktywów Netto na koniec okresu		348,976,284.97

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres od 1 stycznia 2021 do 30 czerwca 2021 roku (c.d.)

	Noty	SANTANDER GO DYNAMIC BOND	USD
Wartość Aktywów Netto na początek okresu		94,245,368.27	
DOCHODY			
Dywidendy netto	3.10	-	
Odsetki z tytułu obligacji netto	3.10	1,587,463.01	
Odsetki bankowe netto	3.10	-	
Odsetki od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.13	139,633.97	
Inne dochody		-	
Dochody ogółem		1,727,096.98	
KOSZTY			
Opłaty za zarządzanie	5	807,512.63	
Opłaty na rzecz depozytariusza	7	68,396.99	
Odsetki bankowe netto	3.10	46,694.04	
Podatek roczny	8	24,849.33	
Amortyzacja wydatków na utworzenie subfunduszy	3.9	-	
Koszty audytu i prawne		6,278.89	
Koszty administracyjne	7	22,221.47	
Inne koszty		58,308.56	
Koszty ogółem		1,034,261.91	
Wynik z inwestycji netto w roku/ okresie		692,835.07	

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres od 1 stycznia 2021 do 30 czerwca 2021 roku (c.d.)

SANTANDER GO
DYNAMIC BOND

	Noty		USD
Wynik z inwestycji netto w okresie		692,835.07	
Zrealizowany dochód/strata netto z tytułu:			
- inwestycji	3.2	(49,056.47)	
- operacji walutowych	3.3	(709,049.46)	
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	(1,621,347.40)	
- kontraktów futures	3.5	1,200,852.57	
- opcji	3.6	153,928.65	
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.13	10,755.66	
Zrealizowany dochód/strata netto za okres		(1,013,916.45)	
Zmiana niezrealizowanego dochodu/straty z tytułu:			
- inwestycji		(943,709.49)	
- operacji walutowych	3.3	2,902.75	
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	944,597.22	
- kontraktów futures	3.5	(841,142.27)	
- opcji	3.6	(39,676.76)	
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.13	(213,569.08)	
Zmiana niezrealizowanego dochodu/straty w okresie		(1,090,597.63)	
Zysk/(strata) netto z operacji		(1,411,679.01)	
Nabycia	4	220,256,485.13	
Umorzenia	4	(24,314,213.25)	
Wyłacone dywidendy	2		
Wartość Aktywów Netto na koniec okresu		288,775,961.14	

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres od 1 stycznia 2021 do 30 czerwca 2021 roku (c.d.)

	Noty	SANTANDER FUTURE WEALTH *	USD
Wartość Aktywów Netto na początek okresu		-	
DOCHODY			
Dywidendy netto	3.10	-	
Odsetki z tytułu obligacji netto	3.10	7.97	
Odsetki bankowe netto	3.10	-	
Odsetki od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.13	-	
Inne dochody		-	
Dochody ogółem		7.97	
KOSZTY			
Opłaty za zarządzanie	5	619,758.30	
Opłaty na rzecz depozytariusza	7	1,851.77	
Odsetki bankowe netto	3.10	24,296.10	
Podatek roczny	8	23,145.11	
Amortyzacja wydatków na utworzenie subfunduszy	3.9	-	
Koszty audytu i prawne		9,416.25	
Koszty administracyjne	7	15,324.80	
Inne koszty		22,738.84	
Koszty ogółem		716,531.17	
Wynik z inwestycji netto w roku/ okresie		(716,523.20)	

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres od 1 stycznia 2021 do 30 czerwca 2021 roku (c.d.)

	Noty		SANTANDER FUTURE WEALTH *
			USD
Wynik z inwestycji netto w okresie		(716,523.20)	
Zrealizowany dochód/strata netto z tytułu:			
- inwestycji	3.2	(2,110,958.41)	
- operacji walutowych	3.3	(203,090.82)	
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	7,071.31	
- kontraktów futures	3.5	301,540.46	
- opcji	3.6	(318,870.15)	
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.13	-	
Zrealizowany dochód/strata netto za okres		(2,324,307.61)	
Zmiana niezrealizowanego dochodu/straty z tytułu:			
- inwestycji		5,335,201.27	
- operacji walutowych	3.3	(7,232.03)	
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	(35,019.07)	
- kontraktów futures	3.5	70,200.00	
- opcji	3.6	(422,905.00)	
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.13	-	
Zmiana niezrealizowanego dochodu/straty w okresie		4,940,245.17	
Zysk/(strata) netto z operacji		1,899,414.36	
Nabycia	4	162,030,179.16	
Umorzenia	4	(8,605,968.58)	
Wyłacone dywidendy	2	-	
Wartość Aktywów Netto na koniec okresu		155,323,624.94	

* Zobacz notę 1

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Dane statystyczne (c.d.)

SANTANDER GO AKCJI PÓŁNOCNO AMERYKAŃSKICH

		30 czerwca 2021	31 grudnia 2020	31 grudnia 2019
Wartość Aktywów Netto	USD	1,989,681,555.05	1,439,913,046.80	312,328,666.29
Klasa A				
Liczba wyemitowanych tytułów		1,134,366.57	948,611.93	993,085.00
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	38.22	35.28	20.77
Klasa B				
Liczba wyemitowanych tytułów		7,803,236.20	6,518,021.46	2,831,633.19
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	43.45	39.97	23.37
Klasa BEH				
Liczba wyemitowanych tytułów		565,317.43	441,402.95	132,968.82
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	176.98	163.73	97.69
Klasa C				
Liczba wyemitowanych tytułów		1,235,047.72	706,564.09	55,474.20
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	19.51	17.96	10.51
Klasa I				
Liczba wyemitowanych tytułów		10,692,494.05	11,809,804.82	8,609,740.61
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	19.88	18.22	10.58
Klasa M				
Liczba wyemitowanych tytułów		1,714,975.49	1,455,034.42	1,146,409.21
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	195.20	178.75	103.59
Klasa ME				
Liczba wyemitowanych tytułów		3,378,744.51	2,330,846.26	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	206.78	183.53	-
Klasa RKP *				
Liczba wyemitowanych tytułów		50.00	-	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	GBP	108.77	-	-
Klasa SE				
Liczba wyemitowanych tytułów		4,321.13	5,180.67	5,035.87
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	175.12	155.56	98.46
Klasa V				
Liczba wyemitowanych tytułów		466,431.49	272,477.41	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	188.01	165.60	-

* Zobacz notę 1

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Dane statystyczne (c.d.)

SANTANDER AM AKCJI EUROPEJSKICH

		30 czerwca 2021	31 grudnia 2020	31 grudnia 2019
Wartość Aktywów Netto	EUR	613,992,335.94	536,288,506.0	691,150,722.98
Klasa A				
Liczba wyemitowanych tytułów		193,143.30	193,143.30	166,001.21
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	193.59	164.55	173.61
Klasa AU				
Liczba wyemitowanych tytułów		2,008.36	1,519.43	3,682.76
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	128.77	113.20	110.12
Klasa B				
Liczba wyemitowanych tytułów		18,539.74	8,532.14	7,058.83
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	141.07	119.61	125.57
Klasa I				
Liczba wyemitowanych tytułów		10,453.47	9,153.71	29,676.44
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	1,793.63	1,513.75	1,574.20
Klasa IKP				
Liczba wyemitowanych tytułów		44,999.48	44,999.48	51,202.48
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	GBP	2,119.11	1,861.56	1,826.18
Klasa M				
Liczba wyemitowanych tytułów		3,647,965.50	3,746,568.56	4,757,969.14
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	121.69	102.43	105.93

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER GO GLOBALNYCH AKCJI ESG**Dane statystyczne (c.d.)**

		30 czerwca 2021	31 grudnia 2020	31 grudnia 2019
Wartość Aktywów Netto	USD	348,976,284.97	158,259,748.20	32,478,614.59
Klasa A				
Liczba wyemitowanych tytułów		22,770.10	5,455.79	100.00
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	120.09	102.70	106.39
Klasa AE				
Liczba wyemitowanych tytułów		159,623.42	55,001.52	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	157.89	130.88	-
Klasa B				
Liczba wyemitowanych tytułów		230,550.88	64,359.88	33,924.00
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	121.17	103.42	106.58
Klasa BE				
Liczba wyemitowanych tytułów		159,034.57	36,359.13	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	158.71	131.30	-
Klasa BEH				
Liczba wyemitowanych tytułów		100,990.65	28,946.35	100.00
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	118.33	106.99	106.99
Klasa I				
Liczba wyemitowanych tytułów		217,363.52	216,798.76	216,560.00
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	121.38	103.28	105.65
Klasa IKP				
Liczba wyemitowanych tytułów		45,000.00	45,000.00	45,000.00
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	GBP	110.16	94.73	99.99
Klasa M				
Liczba wyemitowanych tytułów		1,124,902.93	853,653.47	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	124.54	105.88	-
Klasa RKP				
Liczba wyemitowanych tytułów		1,894,403.71	293,187.71	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	GBP	1.22	1.05	-
Klasa SE *				
Liczba wyemitowanych tytułów		2,717.36	-	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	103.08	-	-
Klasa V				
Liczba wyemitowanych tytułów		406,328.69	101,464.13	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	166.05	135.77	-

* Zobacz notę 1

Dane statystyczne (c.d.)

		30 czerwca 2021	31 grudnia 2020	31 grudnia 2019
Wartość Aktywów Netto	USD	288,775,961.14	94,245,368.27	46,782,324.0
Klasa A				
Liczba wyemitowanych tytułów		26,245.96	196.90	100.00
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	104.29	104.53	100.73
Klasa B				
Liczba wyemitowanych tytułów		588,766.09	220,352.77	598.82
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	104.8	104.92	100.77
Klasa BEH				
Liczba wyemitowanych tytułów		319,074.06	50.00	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	100.31	100.74	-
Klasa I				
Liczba wyemitowanych tytułów		463,190.00	463,190.00	463,190.00
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	106.04	105.73	100.85
Klasa IEH				
Liczba wyemitowanych tytułów		51,390.86	26,161.60	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	100.22	100.33	-
Klasa M				
Liczba wyemitowanych tytułów		832,093.23	187,356.31	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	101.33	100.95	-
Klasa MEH *				
Liczba wyemitowanych tytułów		394,649.85	-	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	99.98	-	-
Klasa RKP *				
Liczba wyemitowanych tytułów		53.09	-	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	GBP	99.56	-	-

* Zobacz notę 1

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Dane statystyczne (c.d.)

SANTANDER FUTURE WEALTH

		30 czerwca 2021	31 grudnia 2020	31 grudnia 2019
Wartość Aktywów Netto	USD	155,323,624.94	-	-
Klasa A *				
Liczba wyemitowanych tytułów		1,259,237.08	-	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	102.66	-	-
Klasa AE *				
Liczba wyemitowanych tytułów		81,340.22	-	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	105.33	-	-
Klasa M *				
Liczba wyemitowanych tytułów		21,176.88	-	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	102.40	-	-
Klasa RKP *				
Liczba wyemitowanych tytułów		482.02	-	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	102.84	-	-
Klasa V *				
Liczba wyemitowanych tytułów		79,464.41	-	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	101.95	-	-
Klasa X *				
Liczba wyemitowanych tytułów		51,295.54	-	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	101.74	-	-
Klasa XE *				
Liczba wyemitowanych tytułów		2,568.77	-	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	107.73	-	-

* Zobacz notę 1

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER GO AKCJI PÓŁNOCNOAMERYKAŃSKICH

Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2021 r.

Waluta	Ilość	Opis	Koszt USD	Wartość rynkowa USD	% WAN
Zbywalne papiery wartościowe dopuszczone do oficjalnego notowania na giełdzie lub znajdujące się w obrocie na innym rynku regulowanym - ogółem					
Akcje					
Kanada					
USD	83,874	SHOPIFY INC	66,368,886.61	122,538,236.52	6.16%
Kanada razem			66,368,886.61	122,538,236.52	6.16%
Szwecja					
USD	270,426	SPOTIFY TECHNOLOGY SA	55,196,347.47	74,526,701.34	3.75%
Szwecja razem			55,196,347.47	74,526,701.34	3.75%
Holandia					
EUR	12,024	ADYEN NV	20,011,386.21	29,381,208.53	1.48%
USD	73,290	ASML HOLDING NV NY REG SHRS	39,724,737.63	50,631,663.60	2.54%
Holandia razem			59,736,123.84	80,012,872.13	4.02%
Wielka Brytania					
USD	690,901	FARFETCH LTD	34,034,939.93	34,793,774.36	1.75%
USD	179,866	ROYALTY PHARMA PLC	46,559,239.26	43,235,268.24	2.17%
Wielka Brytania razem			80,594,179.19	78,029,042.60	3.92%
Stany Zjednoczone					
USD	322,493	ACTIVISION BLIZZARD INC	25,124,488.75	30,778,731.92	1.55%
USD	25,840	AMAZON.COM INC	70,692,948.60	88,893,734.40	4.47%
USD	127,292	AVALARA INC	19,427,030.49	20,595,845.60	1.04%
USD	268,110	CHEWY INC	17,948,406.03	21,371,048.10	1.07%
USD	117,227	COSTCO WHOLESALE CORP	39,763,461.56	46,383,207.09	2.33%
USD	139,194	COUPA SOFTWARE INC	30,338,694.08	36,484,139.34	1.83%
USD	81,443	DANAHER CORP	15,683,566.41	21,856,043.48	1.10%
USD	290,832	DATADOG INC	25,458,364.87	30,269,794.56	1.52%
USD	119,479	DOCUSIGN INC	26,849,581.83	33,402,744.03	1.68%
USD	86,363	FACEBOOK INC	22,485,701.55	30,029,278.73	1.51%
USD	344,434	HEICO CORP	31,957,157.98	42,771,814.12	2.15%
USD	284,007	IAC/INTERACTIVECORP	34,261,084.01	43,785,359.19	2.20%
USD	103,228	INTUITIVE SURGICAL INC	66,459,966.28	94,932,597.92	4.77%
USD	51,331	LULULEMON ATHLETICA INC	16,576,405.13	18,734,275.07	0.94%
USD	195,840	MATCH GROUP INC	22,451,269.09	31,579,200.00	1.59%
USD	207,995	OKTA INC	41,134,461.91	50,892,216.60	2.56%
USD	110,710	PAYPAL HOLDINGS INC	31,855,904.62	32,269,750.80	1.62%
USD	42,315	ROPER TECHNOLOGIES INC	16,633,672.38	19,896,513.00	1.00%
USD	44,455	ROYAL GOLD INC	5,122,495.38	5,072,315.50	0.25%
USD	120,366	SALESFORCE.COM INC	27,203,582.64	29,401,802.82	1.48%
USD	56,566	SERVICENOW INC	21,322,523.32	31,085,845.30	1.56%
USD	763,067	SNAP INC	43,400,897.92	51,995,385.38	2.61%
USD	289,335	SNOWFLAKE INC	72,968,522.81	69,961,203.00	3.52%
USD	424,815	SQUARE INC	56,090,825.66	103,569,897.00	5.21%
USD	282,269	TWILIO INC	75,585,460.93	111,259,149.04	5.59%
USD	1,701,478	TWITTER INC	74,667,962.89	117,078,701.18	5.89%
USD	970,048	UBER TECHNOLOGIES INC	48,993,687.29	48,618,805.76	2.44%
USD	316,841	VEEVA SYSTEMS INC	72,919,475.27	98,521,708.95	4.95%

Informacje dodatkowe stanowią integralną część niniejszych sprawozdań finansowych

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

USD	447,007	VIMEO INC	14,491,754.85	21,903,343.00	1.10%
USD	146,860	WAYFAIR INC	46,901,954.57	46,365,170.60	2.33%
USD	189,703	WORKDAY INC	41,667,683.50	45,289,694.22	2.28%
USD	112,239	ZOETIS INC	16,000,036.57	20,916,860.04	1.05%
USD	573,170	ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	29,333,930.15	29,902,278.90	1.50%
USD	197,335	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	62,504,130.90	76,374,565.05	3.84%
Stany Zjednoczone razem			<u>1,264,277,090.22</u>	<u>1,602,243,019.69</u>	<u>80.53%</u>
Akcje ogółem			<u>1,526,172,627.33</u>	<u>1,957,349,872.28</u>	<u>98.38%</u>
Zbywalne papiery wartościowe dopuszczone do oficjalnego notowania na giełdzie lub znajdujące się w obrocie na innym rynku regulowanym - ogółem			<u>1,526,172,627.33</u>	<u>1,957,349,872.28</u>	<u>98.38%</u>
Inwestycje ogółem			<u>1,526,172,627.33</u>	<u>1,957,349,872.28</u>	<u>98.38%</u>

=

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER GO AKCJI PÓLNOCNOAMERYKAŃSKICH

Klasyfikacja geograficzna inwestycji na dzień 30 czerwca 2021 r.

	% WAN
Stany Zjednoczone	80.53%
Kanada	6.16%
Holandia	4.02%
Wielka Brytania	3.92%
Szwecja	3.75%
Razem	98.38%

Ekonomiczna klasyfikacja inwestycji na dzień 30 czerwca 2021 r.

	% WAN
Internet	39.43%
Oprogramowanie komputerowe	32.30%
Usługi handlowe	9.35%
Produkty ochrony zdrowia	5.87%
Handel detaliczny	3.27%
Półprzewodniki	2.54%
Branża biotechnologiczna Handel detaliczny	2.17%
Przemysł lotniczy i obronny	2.15%
Przemysł farmaceutyczny	1.05%
Branża górnicza	0.25%
Razem	98.38%

Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2021 r.

Waluta	Ilość	Opis	Koszt EUR	Wartość rynkowa EUR	% WAN
Zbywalne papiery wartościowe dopuszczone do oficjalnego notowania na giełdzie lub znajdujące się w obrocie na innym rynku regulowanym – ogółem					
Akcje					
Austria					
EUR	148,983	OMV AG	6,886,739.35	7,146,714.51	1.16%
Austria razem			6,886,739.35	7,146,714.51	1.16%
Belgia					
EUR	180,237	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	10,824,414.00	10,960,211.97	1.79%
Belgia razem			10,824,414.00	10,960,211.97	1.79%
Finlandia					
EUR	752,422	METSO OUTOTEC OYJ	4,988,021.88	7,370,725.91	1.20%
EUR	299,450	UPM-KYMMENE OYJ	8,003,119.28	9,552,455.00	1.56%
Finlandia razem			12,991,141.16	16,923,180.91	2.76%
Francja					
EUR	78,027	AMUNDI SA	4,470,965.84	5,801,307.45	0.94%
EUR	71,017	ARKEMA SA	6,189,216.30	7,513,598.60	1.22%
EUR	392,933	AXA SA	8,962,934.02	8,402,872.21	1.37%
EUR	200,781	BNP PARIBAS SA	9,406,761.06	10,615,291.47	1.73%
EUR	291,640	BUREAU VERITAS SA	6,269,554.80	7,780,955.20	1.27%
EUR	81,964	CAPGEMINI SE	8,833,292.92	13,278,168.00	2.16%
EUR	600,721	CARREFOUR SA	9,609,543.93	9,962,957.79	1.62%
EUR	194,660	CIE DE SAINT-GOBAIN	7,051,652.75	10,811,416.40	1.76%
EUR	84,800	CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN	8,505,242.25	11,405,600.00	1.86%
EUR	576,795	CREDIT AGRICOLE SA	5,138,641.16	6,814,256.13	1.11%
EUR	115,867	EIFFAGE SA	9,170,538.85	9,941,388.60	1.62%
EUR	47,288	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	16,724,077.21	31,271,554.40	5.09%
EUR	200,779	PUBLICIS GROUPE SA	8,373,830.21	10,830,019.26	1.76%
EUR	197,356	SANOFI	16,025,158.59	17,438,376.16	2.84%
EUR	47,973	TELEPERFORMANCE	8,246,233.04	16,421,157.90	2.67%
EUR	410,111	TOTAL SA	15,014,704.78	15,647,785.21	2.55%
EUR	333,409	VIVENDI SA	7,967,009.74	9,445,476.97	1.54%
Francja razem			155,959,357.45	203,382,181.75	33.11%
Niemcy					
EUR	41,078	ADIDAS AG	11,152,416.98	12,894,384.20	2.10%
EUR	59,633	ALLIANZ SE	12,288,680.43	12,540,819.90	2.04%
EUR	199,906	BAYER AG	13,188,935.15	10,237,186.26	1.67%
EUR	99,955	BRENNTAG AG	4,729,784.68	7,838,471.10	1.28%
EUR	161,364	DAIMLER AG	11,611,831.06	12,150,709.20	1.98%
EUR	334,825	DEUTSCHE POST AG	9,016,088.83	19,205,562.00	3.12%
EUR	542,533	DEUTSCHE TELEKOM AG	8,136,009.79	9,663,597.80	1.57%
EUR	204,114	E.ON SE	9,093,126.67	9,486,408.76	1.55%
EUR	326,725	FRESENIUS SE & CO KGAA	8,081,784.97	8,979,995.43	1.46%
EUR	83,482	INFINEON TECHNOLOGIES AG	7,067,295.54	11,049,839.50	1.80%
EUR	19,424	KION GROUP AG	5,667,782.05	7,503,362.16	1.22%
EUR	61,892	MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-GESELLSCHAFT AG IN	4,712,007.93	4,485,972.80	0.73%
EUR	63,922	RHEINMETALL AG	6,002,609.04	5,155,603.60	0.84%

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER AM AKCJI EUROPEJSKICH

EUR	63,922	SAP SE	6,570,399.62	7,596,490.48	1.24%
EUR	139,117	SIEMENS AG	12,790,577.90	18,588,813.54	3.03%
EUR	35,450	VOLKSWAGEN AG	5,831,170.34	7,487,040.00	1.22%
Niemcy razem			<u>135,940,500.98</u>	<u>164,864,256.73</u>	<u>26.85%</u>
Irlandia					
EUR	252,236	CRH PLC	6,709,237.33	10,720,030.00	1.75%
EUR	60,832	KERRY GROUP PLC	6,299,827.50	7,166,009.60	1.17%
EUR	52,114	LINDE PLC	8,638,607.67	12,681,941.90	2.06%
Irlandia razem			<u>21,647,672.50</u>	<u>30,567,981.50</u>	<u>4.98%</u>
Włochy					
EUR	1,773,743	ENEL SPA	11,304,216.89	13,891,955.18	2.27%
EUR	2,617,930	INTESA SANPAOLO SPA	5,837,675.60	6,098,467.94	0.99%
Włochy razem			<u>17,141,892.49</u>	<u>19,990,423.12</u>	<u>3.26%</u>
Portugalia					
EUR	2,125,459	EDP - ENERGIAS DE PORTUGAL SA	7,525,827.83	9,500,801.73	1.55%
Portugalia razem			<u>7,525,827.83</u>	<u>9,500,801.73</u>	<u>1.55%</u>
Hiszpania					
EUR	703,501	ACERINOX SA	6,589,057.53	7,165,157.69	1.17%
EUR	3,522,494	BANCO SANTANDER SA	13,348,399.64	11,340,669.43	1.85%
EUR	265,112	INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA	6,859,099.05	7,876,477.52	1.28%
Hiszpania razem			<u>26,796,556.22</u>	<u>26,382,304.64</u>	<u>4.30%</u>
Holandia					
EUR	118,814	AIRBUS SE	12,756,331.52	12,884,190.16	2.10%
EUR	64,899	ASML HOLDING NV	13,476,183.56	37,602,480.60	6.14%
EUR	597,186	ING GROEP NV	3,958,711.42	6,652,652.04	1.08%
EUR	152,977	KONINKLIJKE PHILIPS NV	6,398,198.60	6,392,908.83	1.04%
EUR	66,494	PROSUS NV	4,506,932.81	5,483,760.18	0.89%
EUR	167,082	SIGNIFY NV	4,192,813.00	8,912,153.88	1.45%
EUR	539,706	STELLANTIS NV	6,509,742.41	8,926,737.24	1.45%
Holandia razem			<u>51,798,913.32</u>	<u>86,854,882.93</u>	<u>14.15%</u>
Akcje ogółem			<u>447,513,015.30</u>	<u>576,572,939.79</u>	<u>96.91%</u>
Zbywalne papiery wartościowe dopuszczone do oficjalnego notowania na giełdzie lub znajdujące się w obrocie na innym rynku regulowanym - ogółem			<u>447,513,015.30</u>	<u>576,572,939.79</u>	<u>93.91%</u>
Inwestycje ogółem			<u>447,513,015.30</u>	<u>576,572,939.79</u>	<u>93.91%</u>

=

Klasyfikacja geograficzna inwestycji na dzień 30 czerwca 2021 r.

	% WAN
Francja	33.11%
Niemcy	26.85%
Holandia	14.15%
Irlandia	4.98%
Hiszpania	4.30%
Włochy	3.26%
Finlandia	2.76%
Belgia	1.79%
Portugalia	1.55%
Austria	1.16%
	93.91%

Ekonomiczna klasyfikacja inwestycji na dzień 30 czerwca 2021 r.

	% WAN
Półprzewodniki	7.94%
Odzież	7.19%
Banki	6.76%
Energetyka	5.37%
Komputery	4.83%
Branża motoryzacyjna	4.65%
Przemysł chemiczny	4.56%
Przemysł farmaceutyczny	4.51%
Ubezpieczenia	4.14%
Ropa naftowa i gaz	3.71%
Materiały budowlane	3.51%
Transport	3.12%
Wytwórczość różna	3.03%
Przemysł lotniczy i obronny	2.94%
Przemysł spożywczy	2.79%
Części i akcesoria samochodowe	1.86%
Napoje	1.79%
Reklama	1.76%
Branża inżynierska i budowlana	1.62%
Telekomunikacja	1.57%
Przemysł drzewny i papierniczy	1.56%
Media	1.54%
Usługi ochrony zdrowia	1.46%
Komponenty i sprzęt elektryczny	1.45%
Handel detaliczny	1.28%
Usługi handlowe	1.27%
Oprogramowanie	1.24%
Maszyny – różne Przemysł metalurgiczny	1.22%
Maszyny – budowlane i górnicze	1.20%
Żelazo i stal	1.17%
Produkty ochrony zdrowia	1.04%
Zróżnicowane usługi finansowe	0.94%
Internet	0.89%
Razem	93.91%

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER GO GLOBALNYCH AKCJE ESG

Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2021 (c.d.)

Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2021 r.

Waluta	Ilość	Opis	Koszt USD	Wartość rynkowa USD	% WAN
<u>Zbywalne papiery wartościowe dopuszczone do oficjalnego notowania na giełdzie lub znajdujące się w obrocie na innym rynku regulowanym – ogółem</u>					
<i>Akcje</i>					
<i>Australia</i>					
EUR	316,401	FORTESCUE METALS GROUP LTD	5,244,100.32	5,544,137.90	1.59%
Australia razem			5,244,100.32	5,544,137.90	1.59%
<i>Chiny</i>					
HKD	146,500	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	3,916,333.13	4,150,221.80	1.19%
Chiny razem			3,916,333.13	4,150,221.80	1.19%
<i>Finlandia</i>					
EUR	153,322	NESTE OYJ	10,024,303.24	9,389,420.27	2.69%
Finlandia razem			10,024,303.24	9,389,420.27	2.69%
<i>Francja</i>					
EUR	70,623	TOTAL SA	3,345,888.93	3,195,550.53	0.92%
Francja razem			3,345,888.93	3,195,550.53	0.92%
<i>Niemcy</i>					
EUR	37,128	DEUTSCHE BOERSE AG	6,202,383.84	6,481,230.01	1.86%
Niemcy razem			6,202,383.84	6,481,230.01	1.86%
<i>Irlandia</i>					
USD	26,410	LINDE PLC	7,884,434.12	7,635,131.00	2.19%
USD	45,377	TRANE TECHNOLOGIES PLC	8,320,272.65	8,355,720.78	2.39%
Irlandia razem			16,204,706.77	15,990,851.78	4.58%
<i>Japonia</i>					
JPY	65,200	SONY CORP	6,398,849.62	6,353,166.95	1.82%
Japonia razem			6,398,849.62	6,353,166.95	1.82%
<i>Szwecja</i>					
SEK	440,838	SANDVIK AB	11,465,587.25	11,268,182.48	3.23%
Szwecja razem			11,465,587.25	11,268,182.48	3.23%

Informacje dodatkowe stanowią integralną część niniejszych sprawozdań finansowych

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER GO GLOBALNYCH AKCJI ESG

Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2021 (c.d.)

Tajwan					
USD	85,787	TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	9,976,267.01	10,308,165.92	2.95%
Tajwan razem			9,976,267.01	10,308,165.92	2.95%
Holandia					
EUR	42,003	KONINKLIJKE DSM NV	7,786,764.01	7,840,307.70	2.25%
EUR	52,366	SIGNIFY NV	3,348,644.89	3,312,458.77	0.95%
Holandia razem			11,135,408.90	11,152,766.47	3.20%
Wielka Brytania					
GBP	70,483	ASOS PLC	4,848,765.81	4,829,489.43	1.38%
GBP	104,321	ASTRAZENECA PLC	11,681,117.23	12,513,439.68	3.59%
USD	112,774	SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	6,535,723.94	6,537,508.78	1.87%
Wielka Brytania razem			23,065,606.98	23,880,437.89	6.84%
Stany Zjednoczone					
USD	5,556	ADOBE INC	2,840,138.28	3,253,815.84	0.93%
USD	47,760	ADVANCE AUTO PARTS INC	9,073,777.49	9,797,486.40	2.81%
USD	61,939	AGCO CORP COMMON STOCK	8,303,809.59	8,075,606.82	2.31%
USD	6,951	ALPHABET INC	14,723,760.89	16,972,882.29	4.86%
USD	2,607	AMAZON.COM INC	8,544,866.71	8,968,497.12	2.57%
USD	24,312	ANTHEM INC	9,516,207.11	9,282,321.60	2.66%
USD	118,873	APPLE INC	15,107,636.62	16,280,846.08	4.67%
USD	42,226	ASPEN TECHNOLOGY INC	5,920,706.63	5,807,764.04	1.66%
USD	311,938	BANK OF AMERICA CORP	11,455,094.83	12,861,203.74	3.69%
USD	1,408	BOOKING HOLDINGS INC	3,295,073.45	3,080,830.72	0.88%
USD	105,637	CBRE GROUP INC	9,317,344.82	9,056,260.01	2.60%
USD	9,871	CHARTER COMMUNICATIONS INC	6,839,271.66	7,121,432.95	2.04%
USD	79,999	COLGATE-PALMOLIVE CO	6,735,241.69	6,507,918.65	1.86%
USD	168,007	EBAY INC	10,140,708.37	11,795,771.47	3.38%
USD	68,293	ELI LILLY & CO	14,162,854.41	15,674,609.36	4.49%
USD	101,579	INTEL CORP	5,783,390.51	5,702,645.06	1.63%
USD	44,256	JPMORGAN CHASE & CO	6,696,373.92	6,883,578.24	1.97%
USD	82,675	MICRON TECHNOLOGY INC	6,828,234.38	7,025,721.50	2.01%
USD	78,759	MICROSOFT CORP	19,442,257.63	21,335,813.10	6.13%
USD	38,158	NASDAQ INC	6,765,801.63	6,708,176.40	1.92%
USD	17,527	S&P GLOBAL INC	6,667,337.96	7,193,957.15	2.06%
USD	12,878	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	5,932,633.51	6,496,564.66	1.86%
USD	26,187	UNITEDHEALTH GROUP INC	10,735,429.18	10,486,322.28	3.00%
USD	34,884	VISA INC	7,945,766.67	8,156,576.88	2.34%
USD	9,667	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	4,852,909.23	5,118,579.83	1.47%
Stany Zjednoczone razem			217,626,627.17	229,645,182.19	65.80%
Akcje ogółem			324,606,063.16	337,359,314.19	96.67%
Zbywalne papiery wartościowe dopuszczone do oficjalnego notowania na giełdzie lub znajdujące się w obrocie na innym rynku regulowanym - ogółem			324,606,063.16	337,359,314.19	96.67%
Inwestycje ogółem			324,606,063.16	337,359,314.19	96.67%

Klasyfikacja geograficzna inwestycji na dzień 30 czerwca 2021 r.

	% WAN
Stany Zjednoczone	65.80%
Wielka Brytania	6.84%
Irlandia	4.58%
Szwecja	3.23%
Holandia	3.20%
Tajwan	2.95%
Finlandia	2.69%
Niemcy	1.86%
Japonia	1.82%
Australia	1.59%
Chiny	1.19%
Francja	0.92%
Razem	96.67%

Ekonomiczna klasyfikacja inwestycji na dzień 30 czerwca 2021 r.

	% WAN
Internet	17.85%
Oprogramowanie	8.72%
Półprzewodniki	6.59%
Różne usługi finansowe	6.12%
Banki	5.66%
Opieka zdrowotna	5.66%
Komputery	4.67%
Przemysł farmaceutyczny	4.49%
Przemysł chemiczny	4.44%
Ropa naftowa i gaz	3.61%
Maszyny – budownictwo i górnictwo	3.23%
Handel detaliczny	2.81%
Nieruchomości	2.60%
Produkcja różna	2.39%
Maszyny - różne	2.31%
Usługi komercyjne	2.06%
Media	2.04%
Elektronika	1.87%
Kosmetyki i higiena osobista	1.86%
Produkty zdrowotne	1.86%
Wyposażenie domów	1.82%
Żelazo i stal	1.59%
Wyposażenie biurowe i biznesowe	1.47%
Komponenty i sprzęt elektryczny	0.95%
Total	96.67%

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER GO DYNAMIC BOND

Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2021 (c.d.)

Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2021 r.

Waluta	Ilość	Opis	Koszt USD	Wartość rynkowa USD	% WAN
Zbywalne papiery wartościowe dopuszczone do oficjalnego notowania na giełdzie lub znajdujące się w obrocie na innym rynku regulowanym - ogółem					
Obligacje					
<i>Australia</i>					
GBP	200,000	APT PIPELINES LTD CALLABLE MEDIUM TERM NOTE FIXED 2.500% 15/03/36	276,202.34	279,304.59	0.10%
USD	200,000	SANTOS FINANCE LTD CALLABLE NOTES FIXED 3.649% 29/04/31	198,940.00	205,809.24	0.07%
USD	200,000	SANTOS FINANCE LTD CALLABLE NOTES FIXED 3.649% 29/04/31	201,182.00	205,179.44	0.07%
USD	100,000	SYDNEY AIRPORT FINANCE CO PTY LTD CALLABLE NOTES 3.900% 22/03/23	105,109.00	105,282.62	0.04%
Total Australia			781,433.34	795,575.89	0.28%
<i>Austria</i>					
EUR	200,000	IMMOFINANZ AG CALLABLE NOTES FIXED 2.500% 15/10/27	242,486.27	245,709.87	0.09%
Total Austria			242,486.27	245,709.87	0.09%
<i>Bermuda</i>					
USD	200,000	VIKING OCEAN CRUISES SHIP VII LTD CALLABLE NOTES 5.625% 15/02/29	200,000.00	202,519.00	0.07%
Total Bermuda			200,000.00	202,519.00	0.07%
<i>Brazil</i>					
USD	200,000	ITAU UNIBANCO HOLDING SA/CAYMAN ISLAND MEDIUM TERM 5.500% 06/08/22	210,730.00	206,550.00	0.07%
USD	1,233,000	PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV CALLABLE NOTES FIXED 5.999% 27/01/28	1,409,852.25	1,417,993.16	0.49%
USD	42,000	PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV NOTES FIXED 6.850% PERP	46,401.60	48,062.70	0.02%
Total Brazil			1,666,983.85	1,672,605.86	0.58%
<i>Canada</i>					
USD	152,000	1011778 BC ULC / NEW RED FINANCE INC CALLABLE 4.250% 15/05/24	154,470.00	153,767.00	0.05%
USD	200,000	BROOKFIELD FINANCE INC CALLABLE NOTES FIXED 4.700% 20/09/47	227,960.99	243,396.96	0.08%
USD	100,000	ENBRIDGE INC NOTES VARIABLE USD 1000 0.880% 18/02/22	100,000.00	100,255.75	0.03%
EUR	150,000	FAIRFAX FINANCIAL HOLDINGS LTD CALLABLE BOND FIXED 2.750% 29/03/28	179,864.50	195,414.07	0.07%
USD	300,000	FAIRFAX FINANCIAL HOLDINGS LTD CALLABLE NOTES 4.625% 29/04/30	323,230.64	344,321.63	0.13%
Total Canada			985,526.13	1,037,155.41	0.36%
<i>Cayman Islands</i>					
USD	1,100,000	ATLAS SENIOR LOAN FUND LTD 2017-8A A FLOATING 1.530% 16/01/30	1,100,220.00	1,100,498.30	0.39%
USD	300,000	AVOLON HOLDINGS FUNDING LTD CALLABLE NOTES FIXED 5.125% 01/10/23	320,832.00	324,408.36	0.11%
USD	115,000	AVOLON HOLDINGS FUNDING LTD CALLABLE NOTES FIXED 5.500% 15/01/23	122,433.70	122,163.72	0.04%
<i>Cayman Islands (continued)</i>					
USD	172,400	BLUEMOUNTAIN CLO 2015-2 LTD 2015-2A AIR FLOATING 1.148% 18/07/27	171,882.44	172,525.49	0.06%
USD	28,000	PARK AEROSPACE HOLDINGS LTD CALLABLE NOTES FIXED 5.250% 15/08/22	29,475.20	29,304.19	0.01%
USD	300,000	SANDS CHINA LTD CALLABLE NOTES FIXED 5.400% 08/08/28	339,570.00	348,876.00	0.12%
Total Cayman Islands			2,084,413.34	2,097,776.06	0.73%
<i>China</i>					
EUR	100,000	BANK OF CHINA LUXEMBOURG SA NOTES FIXED 0.125% 16/01/23	110,756.32	118,994.39	0.04%
Total China			110,756.32	118,994.39	0.04%

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER GO DYNAMIC BOND

Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2021 (c.d.)

<i>France</i>					
EUR	100,000	ALTAREA SCA CALLABLE NOTES FIXED 1.875% 17/01/28	111,449.15	122,920.36	0.04%
USD	200,000	BNP PARIBAS SA CALLABLE MEDIUM TERM NOTE VARIABLE 1.904% 30/09/28	202,952.00	198,527.92	0.07%
USD	400,000	BNP PARIBAS SA CALLABLE MEDIUM TERM NOTE VARIABLE 19/04/32	400,000.00	411,275.76	0.14%
USD	400,000	BNP PARIBAS SA CALLABLE MEDIUM TERM NOTE VARIABLE 3.052% 13/01/31	416,884.00	422,686.48	0.15%
EUR	100,000	CEETRUS SA CALLABLE NOTES FIXED 2.750% 26/11/26	111,794.92	129,720.38	0.04%
EUR	200,000	MUTUELLE ASSURANCE DES COMMERCANTS ET INDUSTRIELS VARIABLE 21/06/52	240,753.77	239,489.97	0.08%
USD	400,000	SOCIETE GENERALE SA CALLABLE BOND VARIABLE PERP	444,400.00	448,128.00	0.16%
USD	100,000	SOCIETE GENERALE SA CALLABLE NOTES VARIABLE USD 6.750% 31/12/64	107,500.00	113,625.00	0.04%
Total France			2,035,733.84	2,086,373.87	0.72%
<i>Germany</i>					
USD	700,000	BAYER US FINANCE II LLC CALLABLE NOTES FIXED 4.375% 15/12/28	822,190.00	803,426.89	0.28%
USD	200,000	DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY CALLABLE NOTES 2.129% 24/11/26	203,733.11	203,160.11	0.07%
USD	700,000	DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY CALLABLE NOTES 3.547% 18/09/31	753,211.00	746,724.02	0.26%
USD	150,000	DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY CALLABLE NOTES 3.961% 26/11/25	150,000.00	162,159.16	0.06%
USD	600,000	DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY CALLABLE NOTES VARIABLE 14/01/32	597,660.00	612,015.36	0.21%
USD	400,000	DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY NOTES FIXED 3.300% 16/11/22	417,866.00	414,193.16	0.14%
EUR	700,000	DEUTSCHE BANK AG CALLABLE MEDIUM TERM NOTE VARIABLE 03/09/26	866,790.26	860,584.32	0.31%
USD	200,000	DEUTSCHE BANK AG CALLABLE NOTES VARIABLE USD 6.000% 31/12/64	200,056.00	212,250.00	0.07%
EUR	100,000	DEUTSCHE BANK AG MEDIUM TERM NOTE FIXED 1.625% 20/01/27	110,683.04	124,772.93	0.04%
GBP	100,000	DEUTSCHE BANK AG MEDIUM TERM NOTE FIXED 2.625% 16/12/24	129,960.69	144,398.32	0.05%
EUR	100,000	FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT SERVICES WORLDWIDE 1.625% 09/07/24	111,845.96	122,763.78	0.04%
EUR	300,000	GRUENENTHAL GMBH CALLABLE BOND FIXED 4.125% 15/05/28	360,674.99	367,474.83	0.13%
EUR	200,000	IHO VERWALTUNGS GMBH CALLABLE BOND FIXED 3.750% 15/09/26	248,401.97	242,328.70	0.08%
<i>Germany (continued)</i>					
EUR	100,000	INEOS STYROLUTION GROUP GMBH CALLABLE BOND FIXED 2.250% 16/01/27	118,861.10	117,344.81	0.04%
GBP	100,000	VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES NV MEDIUM TERM NOTE 0.875% 20/02/25	136,502.74	137,948.89	0.05%
GBP	100,000	VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES NV MEDIUM TERM NOTE 1.125% 18/09/23	127,520.65	139,336.12	0.05%
GBP	200,000	VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES NV MEDIUM TERM NOTE 1.875% 03/12/24	255,605.88	285,025.68	0.10%
EUR	300,000	ZF EUROPE FINANCE BV CALLABLE NOTES FIXED 2.000% 23/02/26	358,014.51	360,247.01	0.12%
Total Germany			5,969,577.90	6,056,154.09	2.10%
<i>Hong Kong</i>					
USD	200,000	MELCO RESORTS FINANCE LTD CALLABLE NOTES FIXED 5.375% 04/12/29	200,000.00	210,827.50	0.07%
Total Hong Kong			200,000.00	210,827.50	0.07%

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER GO DYNAMIC BOND

<i>Ireland</i>					
EUR	300,000	AIB GROUP PLC CALLABLE MEDIUM TERM NOTE VARIABLE 30/05/31	376,487.10	380,887.36	0.13%
USD	100,000	AVOLON HOLDINGS FUNDING LTD CALLABLE NOTES FIXED 3.950% 01/07/24	104,489.00	106,723.37	0.04%
EUR	1,700,000	BLACK DIAMOND CLO LTD 2017-2A A1 FLOATING 0.860% 20/01/32	2,056,574.84	2,016,075.06	0.70%
EUR	200,000	CYRUSONE EUROPE FINANCE DAC CALLABLE NOTES FIXED 1.125% 26/05/28	238,295.71	235,958.64	0.08%
EUR	500,000	OAK HILL EUROPEAN CREDIT PARTNERS IV DESIGNATED 0.730% 20/01/32	595,318.55	593,185.08	0.21%
USD	200,000	PERRIGO FINANCE UNLIMITED CO CALLABLE NOTES FIXED 3.150% 15/06/30	214,130.00	204,617.74	0.07%
EUR	250,000	ST PAUL'S CLO IV DAC 4A ARI FLOATING 0.850% 25/04/30	303,050.75	296,523.37	0.10%
Total Ireland			3,888,345.95	3,833,970.62	1.33%
<i>Isle of Man</i>					
USD	200,000	SASOL FINANCING INTERNATIONAL LTD CALLABLE NOTES 4.500% 14/11/22	206,400.00	205,420.00	0.07%
Total Isle of Man			206,400.00	205,420.00	0.07%
<i>Israel</i>					
USD	300,000	ENERGEAN ISRAEL FINANCE LTD CALLABLE BOND FIXED 4.875% 30/03/26	300,000.00	307,994.40	0.11%
Total Israel			300,000.00	307,994.40	0.11%
<i>Italy</i>					
EUR	100,000	AMCO - ASSET MANAGEMENT CO SPA MEDIUM TERM NOTE 2.250% 17/07/27	113,685.00	129,788.13	0.04%
EUR	600,000	ATLANTIA SPA CALLABLE NOTES FIXED 1.875% 12/02/28	719,556.87	733,244.10	0.26%
EUR	400,000	ATLANTIA SPA MEDIUM TERM NOTE FIXED 1.625% 03/02/25	486,590.16	487,499.77	0.17%
<i>Italy (continued)</i>					
EUR	200,000	INTESA SANPAOLO SPA CALLABLE BOND VARIABLE PERP	296,679.90	290,980.25	0.10%
EUR	300,000	INTESA SANPAOLO SPA MEDIUM TERM NOTE FIXED 0.750% 16/03/28	356,333.88	357,944.77	0.12%
GBP	100,000	INTESA SANPAOLO SPA MEDIUM TERM NOTE FIXED 5.148% 10/06/30	125,965.00	157,712.41	0.05%
EUR	400,000	UNICREDIT SPA CALLABLE BOND VARIABLE PERP	527,320.24	508,953.65	0.18%
USD	400,000	UNICREDIT SPA MEDIUM TERM NOTE FIXED 7.830% 04/12/23	471,100.00	463,704.00	0.16%
Total Italy			3,097,231.05	3,129,827.08	1.08%
<i>Japan</i>					
USD	200,000	MIZUHO FINANCIAL GROUP INC NOTES FIXED 3.477% 12/04/26	210,460.00	218,883.92	0.08%
EUR	500,000	NIDEC CORP CALLABLE BOND FIXED 0.046% 30/03/26	591,524.99	593,203.40	0.21%
EUR	100,000	NISSAN MOTOR CO LTD CALLABLE NOTES FIXED 2.652% 17/03/26	130,859.85	129,327.96	0.04%
USD	400,000	NISSAN MOTOR CO LTD CALLABLE NOTES FIXED 4.345% 17/09/27	419,468.00	440,194.62	0.15%
USD	600,000	NISSAN MOTOR CO LTD CALLABLE NOTES FIXED 4.810% 17/09/30	676,038.00	677,567.31	0.23%
USD	900,000	NOMURA HOLDINGS INC NOTES FIXED 3.103% 16/01/30	952,513.00	946,874.88	0.33%
USD	100,000	SUNTORY HOLDINGS LTD CALLABLE NOTES FIXED 2.550% 28/06/22	100,861.00	101,961.05	0.04%
Total Japan			3,081,724.84	3,108,013.14	1.08%

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER GO DYNAMIC BOND

<i>Jersey</i>						
GBP	300,000	AA BOND CO LTD CALLABLE MEDIUM TERM NOTE FIXED 2.875% 31/07/43	419,879.96	416,427.18	0.15%	
EUR	200,000	ATRIUM FINANCE ISSUER BV CALLABLE MEDIUM TERM NOTE 2.625% 05/09/27	238,526.18	256,688.53	0.09%	
USD	42,620	DORIC NIMROD AIR FINANCE ALPHA LTD 2012-1 CLASS A 5.125% 30/11/24	42,513.13	42,844.86	0.01%	
EUR	100,000	GLOBALWORTH REAL ESTATE INVESTMENTS LTD CALLABLE 2.950% 29/07/26	113,256.65	128,640.62	0.04%	
Total Jersey			814,175.92	844,601.19	0.29%	
<i>Liberia</i>						
USD	100,000	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD CALLABLE NOTES FIXED 10.875% 01/06/23	113,437.50	114,005.00	0.04%	
USD	200,000	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD CALLABLE NOTES FIXED 11.500% 01/06/25	214,250.00	230,762.00	0.08%	
Total Liberia			327,687.50	344,767.00	0.12%	
<i>Luxembourg</i>						
EUR	300,000	ADLER GROUP SA CALLABLE NOTES FIXED 2.250% 27/04/27	356,477.76	351,480.13	0.12%	
EUR	100,000	ALTICE FINANCING SA CALLABLE BOND FIXED 2.250% 15/01/25	111,195.00	115,403.49	0.04%	
EUR	600,000	BEVCO LUX SARL CALLABLE BOND FIXED 1.000% 16/01/30	723,760.20	705,716.76	0.27%	
EUR	100,000	BLACKSTONE PROPERTY PARTNERS EUROPE HOLDINGS SARL 1.250% 26/04/27	117,386.96	121,264.37	0.04%	
EUR	200,000	CBRE GLOBAL INVESTORS OPEN-ENDED FUND SCA 0.500% 27/01/28	240,625.61	235,160.80	0.08%	
EUR	150,000	CPI PROPERTY GROUP SA CALLABLE MEDIUM TERM NOTE 1.625% 23/04/27	163,186.28	183,253.13	0.06%	
EUR	300,000	CPI PROPERTY GROUP SA CALLABLE MEDIUM TERM NOTE 2.750% 12/05/26	397,766.09	387,691.95	0.13%	
<i>Luxembourg (continued)</i>						
EUR	400,000	CROMWELL EREIT LUX FINCO SARL CALLABLE MEDIUM TERM 2.125% 19/11/25	498,341.63	492,526.97	0.17%	
USD	500,000	JAB HOLDINGS BV CALLABLE NOTES FIXED 2.200% 23/11/30	498,940.00	487,808.45	0.17%	
EUR	100,000	JAB HOLDINGS BV NOTES FIXED EUR 1.000% 20/12/27	109,607.97	121,571.70	0.04%	
EUR	100,000	LINCOLN FINANCING SARL CALLABLE NOTES FIXED 3.625% 01/04/24	113,800.62	120,218.24	0.04%	
EUR	150,000	LOGICOR FINANCING SARL CALLABLE MEDIUM TERM NOTE 1.625% 15/07/27	167,684.12	187,596.69	0.06%	
Total Luxembourg			3,498,772.24	3,509,692.68	1.22%	
<i>Mexico</i>						
USD	100,000	PETROLEOS MEXICANOS CALLABLE BOND FIXED 5.950% 28/01/31	100,000.00	97,275.00	0.03%	
Total Mexico			100,000.00	97,275.00	0.03%	
<i>Norway</i>						
USD	200,000	AKER BP ASA CALLABLE NOTES FIXED 3.750% 15/01/30	208,548.00	216,242.98	0.07%	
USD	100,000	EQUINOR ASA CALLABLE BOND FIXED 3.125% 06/04/30	99,210.00	109,091.80	0.04%	
Total Norway			307,758.00	325,334.78	0.11%	
<i>Panama</i>						
USD	100,000	CARNIVAL CORP CALLABLE NOTES FIXED 11.500% 01/04/23	114,375.00	113,252.50	0.04%	
USD	200,000	CARNIVAL CORP CALLABLE NOTES FIXED 7.625% 01/03/26	200,000.00	217,500.00	0.07%	
Total Panama			314,375.00	330,752.50	0.11%	

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER GO DYNAMIC BOND

<i>Qatar</i>					
USD	1,000,000	QNB FINANCE LTD MEDIUM TERM NOTE FIXED 1.125% 17/06/24	999,680.00	1,000,987.50	0.35%
USD	300,000	QNB FINANCE LTD MEDIUM TERM NOTE VARIABLE 1.285% 12/02/22	300,000.00	301,320.00	0.10%
Total Qatar			1,299,680.00	1,302,307.50	0.45%
<i>Spain</i>					
GBP	100,000	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA CALLABLE MEDIUM TERM 3.375% 27/11/26	150,073.84	149,905.45	0.05%
GBP	300,000	BANCO SANTANDER SA MEDIUM TERM NOTE FIXED 1.500% 14/04/26	416,656.44	416,719.43	0.14%
USD	400,000	BANCO SANTANDER SA NOTES FIXED 2.958% 25/03/31	400,000.00	412,909.40	0.14%
GBP	400,000	CADYBANK SA CALLABLE MEDIUM TERM NOTE VARIABLE 03/12/26	564,375.05	553,656.41	0.20%
Total Spain			1,531,105.33	1,533,190.69	0.53%
<i>Supranational</i>					
USD	100,000	DELTA AIR LINES INC / SKYMILES IP LTD CALLABLE 4.500% 20/10/25	100,000.00	107,542.49	0.04%
Total Supranational			100,000.00	107,542.49	0.04%
<i>Sweden</i>					
EUR	200,000	BALDER FINLAND OYJ CALLABLE MEDIUM TERM NOTE FIXED 1.000% 20/01/29	242,235.93	233,756.03	0.08%
EUR	200,000	SAGAX AB CALLABLE NOTES FIXED EUR 2.000% 17/01/24	231,434.56	247,519.48	0.09%
EUR	100,000	SAGAX EURO MTN NL BV CALLABLE MEDIUM TERM NOTE 0.750% 26/01/28	120,683.18	117,719.19	0.04%
EUR	300,000	SAGAX EURO MTN NL BV CALLABLE MEDIUM TERM NOTE 1.000% 17/05/29	360,525.51	354,805.86	0.13%
EUR	150,000	SAMHALLSBYGGNADSBOLAGET I NORDEN AB CALLABLE 1.750% 14/01/25	170,166.78	186,435.09	0.06%
EUR	200,000	SBB TREASURY OYJ CALLABLE MEDIUM TERM NOTE VARIABLE 01/02/23	242,845.03	237,661.14	0.08%
Total Sweden			1,367,890.99	1,377,896.79	0.48%
<i>Switzerland</i>					
USD	200,000	CREDIT SUISSE GROUP AG CALLABLE BOND VARIABLE PERP	212,000.00	209,500.00	0.07%
USD	250,000	CREDIT SUISSE GROUP AG CALLABLE NOTES VARIABLE 02/02/27	250,000.00	245,112.65	0.08%
USD	300,000	CREDIT SUISSE GROUP AG CALLABLE NOTES VARIABLE 12/06/24	305,443.15	304,729.68	0.11%
USD	200,000	CREDIT SUISSE GROUP AG CALLABLE NOTES VARIABLE 5.250% 31/12/64	212,250.00	212,000.00	0.07%
USD	400,000	CREDIT SUISSE GROUP AG CALLABLE NOTES VARIABLE PERP	444,500.00	444,618.00	0.15%
USD	500,000	CREDIT SUISSE GROUP AG CALLABLE NOTES VARIABLE USD 6.375% 31/12/64	554,125.00	556,982.50	0.19%
USD	650,000	CREDIT SUISSE GROUP AG NOTES 4.194% 01/04/31	760,073.50	731,870.88	0.27%
USD	300,000	UBS AG/STAMFORD CT NOTES FIXED 7.625% 17/08/22	331,537.50	322,787.37	0.11%
USD	200,000	UBS AG BOND FIXED 5.125% 15/05/24	221,640.00	220,920.00	0.08%
USD	300,000	UBS GROUP AG CALLABLE MEDIUM TERM NOTE VARIABLE 11/02/32	300,000.00	294,510.39	0.10%
Total Switzerland			3,591,569.15	3,543,031.47	1.23%

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER GO DYNAMIC BOND

<i>The Netherlands</i>					
USD	400,000	ING GROEP NV CALLABLE BOND VARIABLE USD 1000 4.875% 31/12/64	409,400.00	418,750.00	0.15%
USD	100,000	ING GROEP NV CALLABLE BOND VARIABLE USD 1000 5.750% 31/12/64	103,625.00	111,175.00	0.04%
USD	100,000	PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV CALLABLE NOTES FIXED 7.250% 17/03/44	119,150.00	122,785.00	0.04%
USD	100,000	PROSUS NV CALLABLE NOTES FIXED 3.680% 21/01/30	100,000.00	107,250.00	0.04%
EUR	1,000,000	SEGOVIA EUROPEAN CLO 2014-1A AR FLOATING 0.870% 15/04/30	1,213,632.24	1,186,067.86	0.40%
EUR	150,000	STICHTING AK RABOBANK CERTIFICATEN BOND STEP CPN 2.188% PERP	232,139.25	239,920.61	0.08%
EUR	100,000	ZIGGO BOND CO BV CALLABLE NOTES FIXED 3.375% 28/02/30	110,020.00	117,285.51	0.04%
USD	300,000	ZIGGO BOND CO BV CALLABLE NOTES FIXED 5.125% 28/02/30	305,625.00	307,648.50	0.11%
Total The Netherlands			2,593,591.49	2,610,882.48	0.90%
<i>United Arab Emirates</i>					
USD	400,000	DAE FUNDING LLC CALLABLE NOTES FIXED 2.625% 20/03/25	407,318.00	408,026.00	0.14%
USD	200,000	DAE FUNDING LLC CALLABLE NOTES FIXED 3.375% 20/03/28	197,422.00	205,083.00	0.07%
Total United Arab Emirates			604,740.00	613,109.00	0.21%
<i>United Kingdom</i>					
GBP	200,000	BARCLAYS PLC CALLABLE BOND VARIABLE PERP	303,459.44	296,823.04	0.10%
USD	600,000	BARCLAYS PLC CALLABLE NOTES VARIABLE 6.125% 31/12/64	650,030.00	667,500.00	0.23%
USD	400,000	BARCLAYS PLC NOTES FIXED 4.375% 12/01/26	456,357.80	448,298.48	0.16%
GBP	400,000	BELLIS ACQUISITION CO PLC CALLABLE BOND FIXED 3.250% 16/02/26	553,799.99	554,309.43	0.19%
GBP	63,760	FINSBURY SQUARE 2018-2 PLC 2018-2 A FLOATING 1.730% 12/09/68	84,169.66	88,412.15	0.03%
USD	200,000	GAZPROM PJSC VIA GAZ FINANCE PLC BOND FIXED 3.000% 29/06/27	205,500.00	203,457.60	0.07%
USD	600,000	HSBC HOLDINGS PLC CALLABLE NOTES VARIABLE 04/06/31	636,932.00	623,798.46	0.22%
USD	300,000	HSBC HOLDINGS PLC CALLABLE NOTES VARIABLE 18/08/31	309,030.00	300,811.62	0.10%
USD	400,000	HSBC HOLDINGS PLC CALLABLE NOTES VARIABLE 24/05/32	402,984.00	411,783.44	0.14%
USD	200,000	HSBC HOLDINGS PLC CALLABLE NOTES VARIABLE 3.973% 22/05/30	213,292.00	223,915.90	0.08%
USD	300,000	HSBC HOLDINGS PLC CALLABLE NOTES VARIABLE PERP	300,000.00	312,000.00	0.11%
USD	200,000	HSBC HOLDINGS PLC NOTES FIXED 4.950% 31/03/30	199,750.00	240,911.86	0.08%
EUR	400,000	IMPERIAL BRANDS FINANCE NETHERLANDS BV CALLABLE 1.750% 18/03/33	472,484.46	478,842.37	0.17%
USD	100,000	IMPERIAL BRANDS FINANCE PLC CALLABLE NOTES FIXED 3.750% 21/07/22	103,338.00	102,622.16	0.04%
EUR	100,000	INEOS QUATTRO FINANCE 2 PLC CALLABLE BOND FIXED 2.500% 15/01/26	121,505.00	119,921.17	0.04%
EUR	200,000	INFORMA PLC CALLABLE MEDIUM TERM NOTE FIXED 2.125% 06/10/25	255,695.86	252,768.66	0.09%
GBP	500,000	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC CALLABLE MEDIUM 3.375% 08/10/28	719,889.10	748,005.36	0.25%
GBP	200,000	LLOYDS BANKING GROUP PLC CALLABLE BOND VARIABLE PERP	308,971.77	303,061.11	0.10%
EUR	200,000	LLOYDS BANKING GROUP PLC CALLABLE MEDIUM TERM NOTE 0.500% 12/11/25	219,750.33	240,746.89	0.08%
USD	100,000	LLOYDS BANKING GROUP PLC CALLABLE NOTES VARIABLE 6.750% 31/12/64	107,500.00	115,375.00	0.04%
GBP	200,000	MARKS & SPENCER PLC CALLABLE MEDIUM TERM NOTE 3.750% 19/05/26	282,487.34	287,767.08	0.10%
GBP	300,000	MARKS & SPENCER PLC MEDIUM TERM NOTE FIXED 6.000% 12/06/25	448,609.00	466,936.03	0.16%
GBP	100,000	NATIONWIDE BUILDING SOCIETY BOND FIXED 1.000% 24/01/23	130,096.29	139,364.43	0.05%
GBP	25,000	NATIONWIDE BUILDING SOCIETY BOND VARIABLE 10.250% 31/12/64	52,502.10	64,582.79	0.02%
USD	200,000	NATIONWIDE BUILDING SOCIETY CALLABLE MEDIUM TERM VARIABLE 01/08/24	217,780.00	214,642.50	0.07%
USD	300,000	NATIONWIDE BUILDING SOCIETY CALLABLE MEDIUM TERM VARIABLE 08/03/24	319,098.00	315,123.27	0.11%
USD	200,000	NATIONWIDE BUILDING SOCIETY MEDIUM TERM NOTE FIXED 0.550% 22/01/24	199,846.00	199,155.60	0.07%

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER GO DYNAMIC BOND

USD	600,000	NATWEST GROUP PLC CALLABLE NOTES VARIABLE 22/03/25	655,421.00	651,185.34	0.23%
USD	300,000	NATWEST GROUP PLC CALLABLE NOTES VARIABLE 25/06/24	326,542.50	322,189.20	0.11%
EUR	200,000	NE PROPERTY BV CALLABLE MEDIUM TERM NOTE FIXED 2.625% 22/05/23	233,318.75	246,848.07	0.09%
USD	200,000	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC CALLABLE BOND 4.892% 18/05/29	223,640.00	234,705.12	0.08%
USD	400,000	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC CALLABLE BOND 8.625% 31/12/64	411,800.00	404,230.00	0.14%
USD	100,000	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC CALLABLE BOND 8.625% 31/12/64	108,200.00	101,057.50	0.03%
USD	600,000	SANTANDER UK GROUP HOLDINGS PLC CALLABLE NOTES 3.823% 03/11/28	659,500.00	660,538.86	0.23%
USD	200,000	STANDARD CHARTERED PLC CALLABLE BOND VARIABLE PERP	209,200.00	208,846.00	0.07%
USD	200,000	STANDARD CHARTERED PLC CALLABLE NOTES VARIABLE VARIABLE 14/01/27	200,000.00	198,361.03	0.07%
<i>United Kingdom (continued)</i>					
EUR	200,000	TESCO CORPORATE TREASURY SERVICES PLC CALLABLE 0.375% 27/07/29	240,490.03	231,918.56	0.08%
GBP	100,000	VIRGIN MEDIA SECURED FINANCE PLC CALLABLE NOTES 4.250% 15/01/30	128,147.48	138,013.76	0.05%
GBP	200,000	VIRGIN MONEY UK PLC CALLABLE MEDIUM TERM NOTE 4.000% 03/09/27	291,041.94	306,596.62	0.11%
GBP	400,000	VMED O2 UK FINANCING I PLC CALLABLE BOND FIXED 4.500% 15/07/31	556,680.00	555,452.30	0.19%
GBP	200,000	WHITBREAD GROUP PLC CALLABLE NOTES FIXED 2.375% 31/05/27	271,579.16	280,993.57	0.10%
GBP	200,000	WORKSPACE GROUP PLC CALLABLE NOTES FIXED 2.250% 11/03/28	279,358.29	275,204.17	0.10%
Total United Kingdom			13,069,777.29	13,237,076.50	4.58%
<i>United States of America</i>					
USD	367,129	AAMES MORTGAGE INVESTMENT TRUST 2006-1 2006-1 M1 FLOATING 0.572% 25/04/36	357,347.24	360,639.75	0.12%
USD	188,813	ABFC 2005-WMC1 TRUST 2005-WMC1 M3 FLOATING 0.883% 25/06/35	185,862.98	186,790.18	0.06%
USD	112,149	ABFC 2006-OPT2 TRUST 2006-OPT2 A2 FLOATING 1.848% 25/10/36	103,387.08	107,783.08	0.04%
USD	59,783	ACE SECURITIES CORP HOME EQUITY LOAN TRUST SERIES 2.043% 25/05/34	58,438.18	61,417.54	0.02%
USD	500,000	AEGIS ASSET BACKED SECURITIES TRUST MORTGAGE FLOATING 0.797% 25/10/35	491,875.00	491,657.15	0.17%
USD	600,000	AES CORP/THE CALLABLE NOTES FIXED 2.450% 15/01/31	578,286.00	595,307.29	0.21%
USD	288,242	ALASKA AIRLINES 2020-1 CLASS A PASS THROUGH TRUST 4.800% 15/02/29	310,068.38	319,814.03	0.11%
USD	61,305	ALTERNATIVE LOAN TRUST 2006-2CB 2006-2CB A14 5.500% 25/03/36	38,615.58	39,762.96	0.01%
USD	126,570	ALTERNATIVE LOAN TRUST 2006-OA16 2006-OA16 A2 1.982% 25/10/46	118,579.91	122,939.90	0.04%
USD	864,092	ALTERNATIVE LOAN TRUST 2007-HY8C 2007-HY8C A1 FLOATING 0.252% 25/09/47	828,534.87	841,345.81	0.29%
USD	130,190	AMERICAN AIRLINES 2014-1 CLASS A PASS THROUGH 3.700% 01/04/28	127,912.07	132,681.91	0.05%
USD	76,317	AMERICAN AIRLINES 2015-2 CLASS AA PASS THROUGH 3.600% 22/03/29	73,454.99	79,191.25	0.03%
USD	159,326	AMERICAN AIRLINES 2016-3 CLASS AA PASS THROUGH 3.000% 15/04/30	158,592.33	162,456.96	0.06%
USD	83,763	AMERICAN AIRLINES 2017-2 CLASS AA PASS THROUGH 3.350% 15/04/31	78,004.60	85,466.04	0.03%
USD	283,758	AMERICAN AIRLINES 2019-1 CLASS AA PASS THROUGH 3.150% 15/08/33	281,629.78	293,573.29	0.10%
USD	200,000	AMERICAN ASSETS TRUST LP CALLABLE NOTES FIXED 3.375% 01/02/31	206,451.88	206,535.08	0.07%
USD	124,358	AMERICAN HOME MORTGAGE ASSETS TRUST 2006-3 2006-3 1.713% 25/10/46	116,674.56	119,137.92	0.04%
USD	205,330	AMERIQUEST MORTGAGE SECURITIES INC ASSET-BACKED 0.853% 25/11/35	201,993.10	205,595.46	0.07%
USD	100,000	AMERIQUEST MORTGAGE SECURITIES INC ASSET-BACKED 1.123% 25/07/35	95,375.00	99,957.77	0.03%
USD	600,000	AMERIQUEST MORTGAGE SECURITIES INC ASSET-BACKED FLOATING 0.962% 25/01/36	594,750.00	590,551.56	0.20%
USD	708,384	AMERIQUEST MORTGAGE SECURITIES INC ASSET-BACKED FLOATING 1.112% 25/09/34	708,162.19	709,396.63	0.25%
USD	100,000	AMGEN INC CALLABLE NOTES FIXED 2.650% 11/05/22	101,283.26	101,727.09	0.04%
USD	100,000	ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC CALLABLE NOTES 3.500% 01/06/30	99,790.00	111,339.63	0.04%

Informacje dodatkowe stanowią integralną część niniejszych sprawozdań finansowych

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER GO DYNAMIC BOND

United States of America (continued)

USD	100,000	ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC CALLABLE NOTES 4.350% 01/06/40	99,937.00	119,340.50	0.04%
USD	100,000	ARES FINANCE CO II LLC CALLABLE NOTES FIXED 3.250% 15/06/30	99,771.00	103,623.01	0.04%
USD	717,386	ARGENT SECURITIES INC ASSET-BACKED PASS-THROUGH FLOATING 1.892% 25/11/34	718,283.04	725,726.71	0.25%
USD	100,000	ASSET BACKED SECURITIES CORP HOME EQUITY LOAN 1.168% 25/07/35	98,125.00	100,278.36	0.03%
USD	98,243	ASSET BACKED SECURITIES CORP HOME EQUITY LOAN 1.263% 25/02/35	98,181.95	99,070.58	0.03%
EUR	100,000	AT&T INC CALLABLE BOND VARIABLE PERP	124,048.56	120,993.11	0.04%
USD	100,000	AVIATION CAPITAL GROUP LLC CALLABLE NOTES FIXED 4.125% 01/08/25	108,384.00	108,179.54	0.04%
USD	500,000	AVIATION CAPITAL GROUP LLC CALLABLE NOTES FIXED 5.500% 15/12/24	568,433.00	565,662.80	0.20%
USD	100,000	AVIATION CAPITAL GROUP LLC NOTES VARIABLE 2.606% 30/07/21	100,065.00	100,018.90	0.03%
USD	200,000	BANK OF AMERICA CORP CALLABLE MEDIUM TERM NOTE 3.126% 20/01/23	202,965.64	201,185.36	0.07%
USD	100,000	BANK OF AMERICA CORP CALLABLE MEDIUM TERM NOTE 3.974% 07/02/30	109,161.00	113,635.89	0.04%
USD	500,000	BANK OF AMERICA CORP CALLABLE NOTES VARIABLE 22/04/34	506,155.00	515,332.85	0.18%
USD	200,000	BANK OF AMERICA CORP CALLABLE NOTES VARIABLE 29/04/31	212,460.00	206,561.38	0.07%
USD	300,000	BANK OF AMERICA CORP CALLABLE NOTES VARIABLE VARIABLE 11/03/32	300,000.00	308,733.69	0.11%
USD	135,530	BEAR STEARNS ASSET BACKED SECURITIES I TRUST 0.708% 25/04/36	132,819.69	134,708.99	0.05%
USD	107,018	BEAR STEARNS ASSET BACKED SECURITIES I TRUST 1.170% 25/10/35	104,476.10	106,031.14	0.04%
USD	500,000	BEAR STEARNS ASSET BACKED SECURITIES I TRUST FLOATING 0.322% 25/02/37	468,437.50	472,395.20	0.16%
USD	689,394	BEAR STEARNS ASSET BACKED SECURITIES I TRUST FLOATING 0.722% 25/02/36	684,223.91	686,836.91	0.24%
USD	523,227	BEAR STEARNS ASSET BACKED SECURITIES I TRUST FLOATING 0.767% 25/11/35	523,390.02	523,672.40	0.18%
USD	302,967	BEAR STEARNS ASSET BACKED SECURITIES TRUST 1.005% 25/07/34	294,677.91	300,322.79	0.10%
USD	331,496	BEAR STEARNS ASSET BACKED SECURITIES TRUST 2006-3 0.618% 25/08/36	326,873.40	331,430.11	0.11%
EUR	200,000	BECTON DICKINSON EURO FINANCE SARL CALLABLE NOTES 1.213% 12/02/36	241,950.00	235,108.48	0.08%
USD	600,000	BLACK HILLS CORP CALLABLE NOTES FIXED 2.500% 15/06/30	597,816.00	612,419.22	0.21%
USD	300,000	BLUE OWL FINANCE LLC CALLABLE NOTES FIXED 3.125% 10/06/31	296,190.00	299,304.99	0.10%
USD	900,000	BOSTON SCIENTIFIC CORP CALLABLE NOTES FIXED 2.650% 01/06/30	909,753.00	932,727.33	0.32%
USD	700,000	BROADCOM INC CALLABLE NOTES FIXED 2.600% 15/02/33	697,116.00	686,109.69	0.24%
USD	400,000	BROADCOM INC CALLABLE NOTES FIXED 4.300% 15/11/32	437,908.00	456,540.40	0.16%
USD	150,000	CARLYLE FINANCE SUBSIDIARY LLC CALLABLE NOTES 3.500% 19/09/29	149,500.50	161,550.77	0.06%
USD	300,000	CCO HOLDINGS LLC / CCO HOLDINGS CAPITAL CORP 4.500% 15/08/30	315,937.50	313,125.00	0.11%
USD	100,000	CCO HOLDINGS LLC / CCO HOLDINGS CAPITAL CORP 5.000% 01/02/28	105,437.50	105,048.96	0.04%
USD	900,000	CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING LLC / CHARTER 3.900% 01/06/52	873,321.00	919,742.67	0.32%
USD	100,000	CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING LLC / CHARTER 4.908% 23/07/25	114,925.43	113,393.97	0.04%
USD	100,000	CIT GROUP INC CALLABLE NOTES FIXED 5.000% 01/08/23	107,250.00	108,250.00	0.04%

United States of America (continued)

USD	153,759	CITIGROUP MORTGAGE LOAN TRUST 2006-WMC1 2006-WMC1 0.768% 25/12/35	138,191.30	150,612.12	0.05%
USD	795,821	CITIGROUP MORTGAGE LOAN TRUST 2007-AHL3 2007-AHL3 FLOATING 0.262% 25/07/45	690,374.91	693,065.49	0.24%
USD	100,000	CITIGROUP MORTGAGE LOAN TRUST INC 2005-HE1 M4 1.203% 25/05/35	98,750.00	99,007.89	0.03%
USD	100,000	CIT MORTGAGE LOAN TRUST 2007-1 2007-1 1M1 FLOATING 3.292% 25/10/37	101,062.50	101,731.06	0.04%

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER GO DYNAMIC BOND

USD	100,000	COLT MERGER SUB INC CALLABLE NOTES FIXED 6.250% 01/07/25	100,000.00	106,171.00	0.04%
USD	139,279	COUNTRYWIDE ASSET-BACKED CERTIFICATES 2006-22 1A 0.288% 25/06/35	127,962.79	131,571.44	0.05%
USD	388,403	COUNTRYWIDE ASSET-BACKED CERTIFICATES 2007-BC3 2A3 0.328% 25/11/47	377,453.23	396,077.29	0.14%
USD	187,128	CREDIT-BASED ASSET SERVICING AND SECURITIZATION 1.063% 25/01/34	182,274.11	183,503.36	0.06%
USD	200,000	CROCS INC CALLABLE NOTES FIXED 4.250% 15/03/29	200,000.00	204,750.00	0.07%
USD	100,000	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP CALLABLE NOTES 3.150% 15/07/23	103,184.00	105,029.52	0.04%
USD	700,000	CVS HEALTH CORP CALLABLE NOTES FIXED 4.300% 25/03/28	795,795.00	805,435.19	0.28%
USD	100,000	CWABS ASSET-BACKED CERTIFICATES TRUST 2005-16 0.628% 25/05/36	97,500.00	99,508.62	0.03%
USD	600,000	CWABS ASSET-BACKED CERTIFICATES TRUST 2005-3 FLOATING 2.042% 25/08/35	599,250.00	602,318.28	0.21%
USD	500,000	CWABS ASSET-BACKED CERTIFICATES TRUST 2005-7 FLOATING 1.217% 25/11/35	499,687.50	497,595.40	0.17%
USD	350,000	DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP CALLABLE NOTES 6.020% 15/06/26	410,828.21	420,543.45	0.15%
USD	400,000	DELTA AIR LINES INC CALLABLE NOTES FIXED 7.000% 01/05/25	452,500.00	467,248.52	0.16%
USD	764,488	DEUTSCHE ALT-A SECURITIES MORTGAGE LOAN TRUST 0.472% 25/12/36	387,290.69	367,616.24	0.13%
USD	250,000	DISCOVER BANK CALLABLE NOTES FIXED 4.650% 13/09/28	281,797.03	293,885.88	0.10%
USD	350,000	E*TRADE FINANCIAL CORP CALLABLE NOTES FIXED 4.500% 20/06/28	400,639.32	406,100.66	0.14%
USD	150,000	EDISON INTERNATIONAL CALLABLE NOTES FIXED 5.750% 15/06/27	165,408.00	170,951.15	0.06%
USD	600,000	ENTERGY TEXAS INC CALLABLE BOND FIXED 1.750% 15/03/31	560,568.00	576,758.06	0.20%
USD	100,000	ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LLC CALLABLE NOTES 4.050% 15/02/22	104,147.56	102,354.00	0.04%
USD	50,000	EPR PROPERTIES CALLABLE NOTES FIXED 4.500% 01/06/27	53,959.50	53,441.63	0.02%
USD	100,000	EQT CORP CALLABLE NOTES FIXED 6.125% 01/02/25	100,000.00	116,779.00	0.04%
EUR	500,000	EQUINIX INC CALLABLE NOTES FIXED 1.000% 15/03/33	598,663.60	588,069.07	0.20%
USD	500,000	EXPEDIA GROUP INC CALLABLE NOTES FIXED 2.950% 15/03/31	497,771.00	508,623.10	0.18%
USD	176,000	EXPEDIA GROUP INC CALLABLE NOTES FIXED 6.250% 01/05/25	196,722.24	204,765.49	0.07%
USD	100,000	FAIR ISAAC CORP CALLABLE NOTES FIXED 4.000% 15/06/28	100,000.00	103,514.58	0.04%
EUR	100,000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC CALLABLE MEDIUM TERM NOTE 1.744% 19/07/24	108,485.00	120,533.69	0.04%
EUR	300,000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC CALLABLE MEDIUM TERM NOTE 3.250% 15/09/25	386,312.70	381,972.46	0.13%
USD	300,000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC CALLABLE NOTES FIXED 5.584% 18/03/24	325,125.00	328,935.00	0.11%
EUR	100,000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC MEDIUM TERM NOTE VARIABLE 01/12/24	113,700.67	115,592.40	0.04%
EUR	100,000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC NOTES FIXED 2.330% 25/11/25	124,992.81	122,808.36	0.04%
EUR	100,000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC NOTES FIXED 2.386% 17/02/26	124,992.81	123,308.46	0.04%
USD	100,000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC NOTES FIXED 5.596% 07/01/22	99,750.00	102,177.00	0.04%
USD	1,013,000	FREMONT HOME LOAN TRUST 2005-2 2005-2 M4 FLOATING 1.098% 25/06/35	990,848.75	993,876.48	0.34%
USD	100,000	GAP INC/THE CALLABLE NOTES FIXED 8.875% 15/05/27	116,375.00	115,969.50	0.04%

United States of America (continued)

USD	150,000	GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE CALLABLE BOND VARIABLE 4.223% 01/05/29	164,662.50	171,328.62	0.06%
EUR	100,000	GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE CALLABLE MEDIUM TERM 0.307% 21/04/23	111,415.00	118,855.63	0.04%
EUR	300,000	GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE CALLABLE MEDIUM TERM VARIABLE 30/04/24	362,438.75	356,042.26	0.12%
USD	200,000	GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE CALLABLE NOTES FIXED 0.523% 08/03/23	200,000.00	200,186.50	0.07%
USD	300,000	GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE CALLABLE NOTES VARIABLE 05/06/28	338,949.00	331,621.77	0.11%
USD	200,000	GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE CALLABLE NOTES VARIABLE 08/03/24	200,000.00	200,374.80	0.07%
USD	500,000	GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE CALLABLE NOTES VARIABLE 09/03/27	500,000.00	499,021.97	0.17%
USD	120,174	GSAMP TRUST 2004-OPT 2004-OPT M1 FLOATING 1.018% 25/11/34	116,118.02	119,474.11	0.04%
USD	500,000	GSAMP TRUST 2005-HE6 2005-HE6 M2 FLOATING 0.767% 25/11/35	495,937.50	494,869.15	0.17%
USD	244,612	GSAMP TRUST 2006-FM3 2006-FM3 A2C FLOATING 0.368% 25/11/36	132,702.24	152,866.67	0.05%

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER GO DYNAMIC BOND

USD	200,000	HILTON DOMESTIC OPERATING CO INC CALLABLE NOTES 3.625% 15/02/32	200,000.00	197,500.00	0.07%
USD	200,000	HILTON DOMESTIC OPERATING CO INC CALLABLE NOTES 4.000% 01/05/31	200,000.00	202,040.00	0.07%
USD	100,000	HILTON DOMESTIC OPERATING CO INC CALLABLE NOTES 5.750% 01/05/28	100,000.00	108,466.00	0.04%
USD	700,000	HOME EQUITY ASSET TRUST 2005-5 2005-5 M4 FLOATING 1.037% 25/11/35	695,187.50	692,579.09	0.24%
USD	182,440	HSI ASSET SECURITIZATION CORP TRUST 2007-HE2 0.498% 25/04/37	122,348.60	121,431.63	0.04%
USD	150,000	HUDSON PACIFIC PROPERTIES LP CALLABLE NOTES FIXED 3.250% 15/01/30	149,577.00	158,634.30	0.05%
USD	359,495	INDYMAC INDX MORTGAGE LOAN TRUST 2006-AR15 0.358% 25/07/36	353,460.68	344,719.27	0.12%
USD	434,950	INDYMAC INDX MORTGAGE LOAN TRUST 2007-FLX1 0.342% 25/02/37	338,173.48	346,457.21	0.12%
USD	150,000	JPMORGAN CHASE & CO CALLABLE NOTES VARIABLE 3.702% 06/05/30	161,068.50	167,875.76	0.06%
USD	71,829	LEHMAN XS TRUST 2007-3 2007-3 1BA2 FLOATING 0.743% 25/03/37	70,218.86	73,454.97	0.03%
USD	108,152	LEHMAN XS TRUST SERIES 2006-18N 2006-18N A3 0.330% 25/12/36	105,717.81	111,424.16	0.04%
USD	100,000	LIVE NATION ENTERTAINMENT INC CALLABLE NOTES FIXED 6.500% 15/05/27	100,000.00	111,277.50	0.04%
USD	243,172	LONG BEACH MORTGAGE LOAN TRUST 2004-5 2004-5 M1 FLOATING 0.742% 25/09/34	235,572.43	238,805.91	0.08%
USD	483,974	LONG BEACH MORTGAGE LOAN TRUST 2006-8 2006-8 1A FLOATING 0.242% 25/09/36	361,770.23	356,816.66	0.12%
USD	300,000	MARRIOTT OWNERSHIP RESORTS INC CALLABLE NOTES 6.125% 15/09/25	320,625.00	319,941.00	0.11%
USD	800,000	MARVELL TECHNOLOGY INC CALLABLE NOTES FIXED 2.950% 15/04/31	803,376.00	830,817.44	0.29%
USD	200,000	MIDWEST CONNECTOR CAPITAL CO LLC CALLABLE NOTES 3.900% 01/04/24	204,500.00	209,311.74	0.07%
USD	200,000	MILEAGE PLUS HOLDINGS LLC / MILEAGE PLUS 6.500% 20/06/27	206,750.00	220,450.00	0.08%
USD	161,801	MORGAN STANLEY ABS CAPITAL I INC TRUST 2003-NC8 1.198% 25/09/33	157,553.71	161,387.43	0.06%
USD	702,905	MORGAN STANLEY ABS CAPITAL I INC TRUST 2005-HE2 FLOATING 0.812% 25/01/35	671,493.55	673,946.69	0.23%
USD	192,142	MORGAN STANLEY ABS CAPITAL I INC TRUST 2007-NC2 0.368% 25/02/37	104,957.51	116,278.07	0.04%
USD	351,725	MORGAN STANLEY ABS CAPITAL I INC TRUST 2007-NC2 FLOATING 0.242% 25/02/37	209,386.21	211,472.74	0.07%
<i>United States of America (continued)</i>					
USD	153,596	MORGAN STANLEY CAPITAL I INC TRUST 2006-HE2 0.508% 25/03/36	130,940.78	137,060.33	0.05%
USD	422,704	MORGAN STANLEY MORTGAGE LOAN TRUST 2006-11 2006-11 6.354% 25/08/36	145,568.79	128,004.33	0.04%
GBP	150,000	MPT OPERATING PARTNERSHIP LP / MPT FINANCE CORP 3.692% 05/06/28	193,848.62	221,200.12	0.08%
USD	400,000	NATIONAL FUEL GAS CO CALLABLE NOTES FIXED 2.950% 01/03/31	389,544.00	403,526.76	0.14%
USD	100,000	NCL CORP LTD CALLABLE NOTES FIXED 10.250% 01/02/26	100,000.00	117,500.00	0.04%
USD	685,116	NEW CENTURY HOME EQUITY LOAN TRUST 2004-3 2004-3 1.098% 25/11/34	671,770.57	675,162.14	0.23%
USD	700,000	NEW CENTURY HOME EQUITY LOAN TRUST 2005-4 2005-4 FLOATING 1.037% 25/09/35	700,000.00	700,926.73	0.24%
USD	300,000	NEXTERA ENERGY CAPITAL HOLDINGS INC CALLABLE BOND 2.750% 01/05/25	321,139.88	318,966.33	0.11%
USD	100,000	NEXTERA ENERGY CAPITAL HOLDINGS INC NOTES FIXED 2.403% 01/09/21	100,566.22	100,364.35	0.03%
USD	200,000	NEXTERA ENERGY CAPITAL HOLDINGS INC NOTES VARIABLE 01/03/23	200,000.00	201,127.52	0.07%
USD	100,000	NISSAN MOTOR ACCEPTANCE CORP CALLABLE MEDIUM TERM 1.900% 14/09/21	99,305.00	100,281.68	0.03%
USD	200,922	NOVASTAR MORTGAGE FUNDING TRUST SERIES 2007-2 0.328% 25/09/37	194,815.78	198,760.98	0.07%
USD	150,000	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC CALLABLE NOTES 4.750% 15/01/28	163,872.00	169,387.98	0.06%
USD	100,000	ONEOK INC CALLABLE NOTES FIXED 6.350% 15/01/31	99,667.00	129,568.02	0.04%

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER GO DYNAMIC BOND

USD	863,725	OPTION ONE MORTGAGE LOAN TRUST 2005-1 2005-1 M1 FLOATING 0.872% 25/02/35	861,566.04	861,183.07	0.30%
USD	280,360	OPTION ONE MORTGAGE LOAN TRUST 2007-5 2007-5 1A1 FLOATING 0.312% 25/05/37	209,043.70	208,287.09	0.07%
USD	685,817	OPTION ONE MORTGAGE LOAN TRUST 2007-CP1 2007-CP1 FLOATING 0.232% 25/03/37	635,237.65	641,652.51	0.22%
USD	500,000	ORACLE CORP CALLABLE NOTES FIXED 2.875% 2.875% 25/03/31	505,925.00	521,299.65	0.18%
USD	400,000	ORGANON & CO / ORGANON FOREIGN DEBT CO-ISSUER BV 4.125% 30/04/28	400,000.00	408,420.00	0.14%
USD	100,000	PACIFIC GAS & ELECTRIC CO CALLABLE NOTES 3.750% 15/08/42	103,500.00	91,487.41	0.03%
USD	100,000	PACIFIC GAS AND ELECTRIC CO BOND VARIABLE 1.600% 15/11/21	100,000.00	100,210.55	0.03%
USD	400,000	PACIFIC GAS AND ELECTRIC CO CALLABLE BOND FIXED 3.250% 01/06/31	399,152.00	394,347.29	0.14%
USD	100,000	PACIFIC GAS AND ELECTRIC CO CALLABLE BOND FIXED 3.300% 01/08/40	99,501.00	90,607.19	0.03%
USD	700,000	PACIFIC GAS AND ELECTRIC CO CALLABLE BOND FIXED 4.550% 01/07/30	782,647.00	750,069.81	0.26%
USD	400,000	PARK INTERMEDIATE HOLDINGS LLC / PK DOMESTIC 4.875% 15/05/29	400,000.00	414,280.00	0.14%
USD	300,000	PARK INTERMEDIATE HOLDINGS LLC / PK DOMESTIC 7.500% 01/06/25	317,625.00	326,143.50	0.11%
USD	200,000	PENSKE TRUCK LEASING CO LP / PTL FINANCE CORP 4.450% 29/01/26	229,381.83	224,931.58	0.08%
USD	100,000	PENSKE TRUCK LEASING CO LP / PTL FINANCE CORP 4.875% 11/07/22	106,462.21	104,334.89	0.04%
USD	140,455	RALI SERIES 2007-QA1 TRUST 2007-QA1 A3 FLOATING 0.318% 25/01/37	129,968.32	130,709.50	0.05%
USD	130,732	RALI SERIES 2007-QA5 TRUST 2007-QA5 2A1 VARIABLE 6.110% 25/09/37	94,453.56	113,539.62	0.04%
USD	167,368	RAMP SERIES 2007-RS2 TRUST 2007-RS2 A3 FLOATING 0.518% 25/05/37	150,585.86	159,496.57	0.06%
USD	100,000	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC CALLABLE NOTES FIXED 4.650% 01/04/30	99,668.00	119,862.36	0.04%
<i>United States of America (continued)</i>					
USD	1,307,771	RENAISSANCE HOME EQUITY LOAN TRUST 2006-3 AF3 STEP 5.586% 25/11/36	673,502.07	689,831.81	0.24%
USD	240,589	RIO OIL FINANCE TRUST SERIES 2014-1 CALLABLE NOTES 9.250% 06/07/24	273,068.47	267,053.73	0.09%
USD	350,000	SABINE PASS LIQUEFACTION LLC CALLABLE NOTES FIXED 5.000% 15/03/27	397,569.08	404,770.14	0.14%
USD	141,642	SAXON ASSET SECURITIES TRUST 2004-1 2004-1 A 0.688% 25/03/35	129,690.94	136,947.64	0.05%
USD	138,997	SECURITIZED ASSET BACKED RECEIVABLES LLC TRUST 0.290% 25/07/36	120,232.37	126,483.75	0.04%
USD	101,186	SLM STUDENT LOAN TRUST 2008-9 2008-9 A FLOATING 1.718% 25/04/23	102,032.35	102,140.36	0.04%
USD	91,081	SOUNDVIEW HOME LOAN TRUST 2005-4 2005-4 M2 0.853% 25/03/36	90,483.52	91,264.20	0.03%
USD	700,000	SOUNDVIEW HOME LOAN TRUST 2005-4 2005-4 M3 FLOATING 0.842% 25/03/36	700,000.00	700,702.66	0.24%
USD	100,000	SOUNDVIEW HOME LOAN TRUST 2006-EQ1 2006-EQ1 A4 0.418% 25/10/36	94,250.00	97,489.01	0.03%
USD	124,850	SOUNDVIEW HOME LOAN TRUST 2007-1 2007-1 1A1 0.300% 25/03/37	116,110.94	120,876.58	0.04%
USD	513,882	SOUNDVIEW HOME LOAN TRUST 2007-OPT2 2007-OPT2 1A1 FLOATING 0.262% 25/07/37	475,661.96	478,934.87	0.17%
USD	200,000	SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO CALLABLE BOND FIXED 3.700% 01/08/25	213,530.42	217,953.28	0.08%
USD	100,000	SOUTHERN CO/THE CALLABLE NOTES FIXED 3.700% 30/04/30	99,751.00	110,489.40	0.04%
USD	200,000	SOUTHWEST AIRLINES CO CALLABLE NOTES FIXED 5.250% 04/05/25	215,034.44	228,391.06	0.08%
USD	694,555	SPECIALTY UNDERWRITING & RESIDENTIAL FINANCE TRUST FLOATING 0.242% 25/11/37	480,979.41	494,209.23	0.17%
USD	200,000	SPIRIT AEROSYSTEMS INC CALLABLE NOTES FIXED 4.600% 15/06/28	218,084.02	196,505.00	0.07%
USD	100,000	SPRINGLEAF FINANCE CORP CALLABLE NOTES FIXED 6.125% 15/05/22	107,125.00	104,150.00	0.04%
USD	100,000	SPRINT CORP CALLABLE NOTES FIXED 7.250% 15/09/21	106,125.00	101,686.50	0.04%
EUR	150,000	STANDARD INDUSTRIES INC/NJ CALLABLE NOTES FIXED 2.250% 21/11/26	166,501.44	177,457.99	0.06%
USD	137,402	STRUCTURED ASSET MORTGAGE INVESTMENTS II TRUST 0.330% 25/07/46	114,671.54	122,388.65	0.04%
USD	157,308	STRUCTURED ASSET SECURITIES CORP MORTGAGE LOAN 0.305% 25/09/36	123,880.23	123,356.73	0.04%

Informacje dodatkowe stanowią integralną część niniejszych sprawozdań finansowych

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER GO DYNAMIC BOND

USD	300,000	SYNCHRONY FINANCIAL CALLABLE NOTES FIXED 3.950% 01/12/27	334,125.00	334,197.48	0.12%
USD	150,000	SYNCHRONY FINANCIAL CALLABLE NOTES FIXED 4.500% 23/07/25	160,986.00	167,941.97	0.06%
USD	100,000	SYSTEMS ENERGY RESOURCES INC CALLABLE BOND FIXED 2.140% 09/12/25	99,967.00	101,197.77	0.04%
USD	100,000	TEGNA INC CALLABLE NOTES FIXED 4.625% 15/03/28	100,000.00	103,875.00	0.04%
USD	100,000	T-MOBILE USA INC CALLABLE NOTES FIXED 2.050% 15/02/28	99,787.00	101,701.50	0.04%
USD	200,000	T-MOBILE USA INC CALLABLE NOTES FIXED 2.250% 15/11/31	197,365.71	198,041.00	0.07%
USD	100,000	T-MOBILE USA INC CALLABLE NOTES FIXED 3.600% 15/11/60	99,745.00	101,935.00	0.04%
USD	475,825	UNITED AIRLINES 2020-1 CLASS A PASS THROUGH TRUST 5.875% 15/04/29	518,649.25	529,102.46	0.18%
USD	300,000	UNITED AIRLINES INC CALLABLE NOTES FIXED 4.625% 15/04/29	300,000.00	310,875.00	0.11%
USD	150,000	UNIVISION COMMUNICATIONS INC CALLABLE NOTES FIXED 5.125% 15/02/25	144,562.50	153,488.25	0.05%
USD	300,000	UNIVISION COMMUNICATIONS INC CALLABLE NOTES FIXED 9.500% 01/05/25	330,187.50	331,774.50	0.11%
USD	500,000	VERIZON COMMUNICATIONS INC CALLABLE NOTES FIXED 2.550% 21/03/31	498,260.00	512,024.75	0.18%
EUR	300,000	WABTEC TRANSPORTATION NETHERLANDS BV CALLABLE 1.250% 03/12/27	363,361.89	359,002.53	0.12%
USD	28,735	WAMU MORTGAGE PASS-THROUGH CERTIFICATES SERIES 2.811% 25/05/46	25,717.60	28,440.31	0.01%
USD	652,271	WAMU MORTGAGE PASS-THROUGH CERTIFICATES SERIES VARIABLE 25/09/36	651,455.99	644,859.57	0.22%
<i>United States of America (continued)</i>					
USD	100,000	WELLS FARGO & CO CALLABLE MEDIUM TERM NOTE 3.196% 17/06/27	103,008.00	108,035.45	0.04%
USD	700,000	WELLS FARGO & CO CALLABLE MEDIUM TERM NOTE VARIABLE 04/31/31	845,579.00	829,066.28	0.29%
USD	1,100,000	WELLS FARGO HOME EQUITY ASSET-BACKED SECURITIES 0.450% 25/04/37	909,375.00	923,727.31	0.32%
EUR	200,000	WPC EUROBOND BV CALLABLE NOTES FIXED 1.350% 15/04/28	220,387.63	245,691.06	0.09%
Total United States of America			56,105,926.02	56,934,819.51	19.71%
Obligacje razem			110,477,661.76	111,821,196.1	38.72%
Obligacje skarbowe					
<i>Australia</i>					
AUD	3,400,000	COMMONWEALTH OF AUSTRALIA BOND FIXED 2.500% 21/05/30	2,827,605.49	2,794,237.08	0.97%
Total Australia			2,827,605.49	2,794,237.08	0.97%
<i>Brazil</i>					
BRL	2,800,000	FEDERATIVE REPUBLIC OF BRAZIL BILL ZERO CPN 0.000% 01/01/22	4,871,771.86	5,426,195.16	1.88%
Total Brazil			4,871,771.86	5,426,195.16	1.88%
<i>Dominican Republic</i>					
USD	150,000	DOMINICAN REPUBLIC CALLABLE BOND FIXED 5.300% 21/01/41	150,000.00	150,009.38	0.05%
Total Dominican Republic			150,000.00	150,009.38	0.05%
<i>Israel</i>					
ILS	6,000,000	STATE OF ISRAEL BILL ZERO CPN 0.000% 30/11/21	1,847,247.66	1,841,430.11	0.64%
ILS	10,400,000	STATE OF ISRAEL BOND FIXED 5.500% 31/01/22	3,333,083.80	3,367,193.49	1.16%
USD	600,000	STATE OF ISRAEL BOND FIXED USD 3.800% 13/05/60	691,800.00	684,746.40	0.24%
Total Israel			5,872,131.46	5,893,370.00	2.04%
<i>Japan</i>					
JPY	2,000,000,000	JAPAN BILL ZERO CPN 0.000% 05/07/21	18,260,526.68	18,019,837.82	6.24%
JPY	310,000,000	JAPAN BILL ZERO CPN 0.000% 27/09/21	2,799,150.98	2,793,744.36	0.97%
Total Japan			21,059,677.66	20,813,582.18	7.21%

Informacje dodatkowe stanowią integralną część niniejszych sprawozdań finansowych

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER GO DYNAMIC BOND**Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2021 (c.d.)**

<i>Kuwait</i>					
USD	500,000	KUWAIT INTERNATIONAL GOVERNMENT BOND BOND FIXED 2.750% 20/03/22	511,725.00	509,142.50	0.18%
Total Kuwait			511,725.00	509,142.50	0.18%
<i>Peru</i>					
PEN	200,000	REPUBLIC OF PERU BOND FIXED 5.940% 12/02/29	64,550.91	57,173.68	0.02%
PEN	6,100,000	REPUBLIC OF PERU BOND FIXED 6.950% 12/08/31	2,125,619.70	1,790,411.12	0.62%
PEN	1,200,000	REPUBLIC OF PERU BOND FIXED PEN 6.350% 12/08/28	412,640.90	350,942.85	0.12%
Total Peru			2,602,811.51	2,198,527.65	0.76%
<i>Qatar</i>					
USD	400,000	STATE OF QATAR CALLABLE BOND FIXED 3.875% 23/04/23	428,880.00	425,124.80	0.15%
USD	600,000	STATE OF QATAR CALLABLE BOND FIXED 4.500% 23/04/28	717,510.00	709,230.00	0.24%
Total Qatar			1,146,390.00	1,134,354.80	0.39%
<i>Saudi Arabia</i>					
USD	500,000	KINGDOM OF SAUDI ARABIA MEDIUM TERM NOTE FIXED 2.375% 26/10/21	506,100.00	503,260.00	0.17%
Total Saudi Arabia			506,100.00	503,260.00	0.17%
<i>South Africa</i>					
ZAR	58,600,000	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA BOND FIXED 10.500% 21/12/26	4,433,527.31	4,669,121.60	1.61%
USD	400,000	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA BOND FIXED 4.850% 30/09/29	412,680.00	425,330.00	0.15%
Total South Africa			4,846,207.31	5,094,451.60	1.76%
<i>Spain</i>					
EUR	400,000	AUTONOMOUS COMMUNITY OF CATALONIA MEDIUM TERM NOTE 4.900% 15/09/21	496,610.78	479,582.04	0.17%
Total Spain			496,610.78	479,582.04	0.17%
<i>Turkey</i>					
USD	250,000	REPUBLIC OF TURKEY BOND FIXED 6.350% 10/08/24	261,750.00	262,858.75	0.09%
Total Turkey			261,750.00	262,858.75	0.09%
<i>United States of America</i>					
USD	10,000,000	TBA GNMA2 SINGLE FAMILY 30YR 4.000% 15/07/51	10,614,062.50	10,560,156.00	3.66%
USD	100,000	TOBACCO SETTLEMENT FIN AUTH WEST VA ASSET BACKED 3.401% 01/06/34	100,000.00	103,918.00	0.04%
USD	2,000,000	UNITED STATES OF AMERICA BILL ZERO CPN 0.000% 24/08/21	1,999,883.33	1,999,887.50	0.69%
USD	9,500,000	UNITED STATES OF AMERICA BILL ZERO CPN 0.000% 26/08/21	9,497,502.56	9,499,445.87	3.29%
USD	5,600,000	UNITED STATES OF AMERICA BOND FIXED 1.875% 15/02/41	5,319,733.12	5,489,750.00	1.90%
USD	3,700,000	UNITED STATES OF AMERICA NOTES FIXED 0.125% 30/11/22	3,700,253.90	3,698,265.63	1.28%
USD	800,000	UNITED STATES OF AMERICA NOTES FIXED 0.125% 31/01/23	800,156.25	799,312.50	0.28%
USD	300,000	UNITED STATES OF AMERICA NOTES FIXED 0.375% 30/04/25	300,468.75	296,929.69	0.10%
USD	1,700,000	UNITED STATES OF AMERICA NOTES FIXED 0.375% 30/11/25	1,700,226.56	1,670,316.40	0.58%
USD	1,300,000	UNITED STATES OF AMERICA NOTES FIXED 0.375% 31/01/26	1,295,027.35	1,274,660.15	0.44%
USD	3,100,000	UNITED STATES OF AMERICA NOTES FIXED 1.500% 30/11/21	3,094,792.97	3,118,471.04	1.08%

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER GO DYNAMIC BOND

Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2021 (c.d.)

United States of America (continued)

USD	3,900,000	UNITED STATES OF AMERICA NOTES FIXED 1.500% 31/10/21	3,892,382.81	3,918,742.62	1.36%
USD	1,100,000	UNITED STATES OF AMERICA NOTES FIXED 1.500% 31/10/24	1,093,642.73	1,135,406.25	0.39%
USD	4,500,000	UNITED STATES OF AMERICA NOTES FIXED 2.000% 30/06/24	4,578,222.66	4,707,245.70	1.63%
Total United States of America			47,986,355.49	48,272,507.35	16.72%
Obligacje skarbowe razem			93,139,136.56	93,532,078.49	32.39%
Instrumenty rynku pieniężnego					
Stany Zjednoczone					
USD	2,900,000	FEDERAL HOME LOAN BANKS DISCOUNT NOTES ZERO CPN 0.000% 01/09/21	2,899,868.05	2,899,800.22	1.00%
USD	3,600,000	FEDERAL HOME LOAN BANKS DISCOUNT NOTES ZERO CPN 0.000% 12/07/21	3,599,931.00	3,599,978.00	1.25%
USD	3,200,000	FEDERAL HOME LOAN BANKS DISCOUNT NOTES ZERO CPN 0.000% 14/07/21	3,199,985.07	3,199,976.90	1.11%
Stany Zjednoczone razem			9,699,784.12	9,699,755.12	3.36%
Instrumenty rynku pieniężnego razem			9,699,784.12	9,699,755.12	3.36%
Zbywalne papiery wartościowe dopuszczone do oficjalnego notowania na giełdzie lub znajdujące się w obrocie na innym rynku regulowanym			213,316,582.44	215,053,030.37	74.47%
Fundusze inwestycyjne					
Irlandia					
USD	2,750,991	PIMCO SELECT FUNDS PLC - US DOLLAR SHORT-TERM	27,423,151.63	27,402,625.15	9.49%
Irlandia razem			27,423,151.63	27,402,625.15	9.49%
Fundusze inwestycyjne razem			27,423,151.63	27,402,625.15	9.49%
Inwestycje ogółem			240,739,734.07	242,455,655.52	83.96%

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Klasyfikacja geograficzna inwestycji na dzień 30 czerwca 2021 r.

	% WAN
Stany Zjednoczone	41.68%
Irlandia	9.81%
Japonia	8.29%
Wielka Brytania	4.55%
Brazylia	2.46%
Izrael	2.15%
Niemcy	2.10%
RPA	1.76%
Australia	1.25%
Szwajcaria	1.23%
Luksemburg	1.22%
Włochy	1.08%
Katar	0.84%
Peru	0.76%
Francja	0.72%
Hiszpania	0.70%
Holandia	0.50%
Szwecja	0.48%
Kanada	0.36%
Jersey	0.29%
Kajmany	0.28%
Zjednoczone Emiraty Arabskie	0.21%
Kuwejt	0.18%
Arabia Saudyjska	0.17%
Liberia	0.12%
Norwegia	0.11%
Panama	0.11%
Austria	0.09%
Turcja	0.09%
Bermudy	0.07%
Hongkong	0.07%
Wyspa Man	0.07%
Republika Dominikany	0.05%
Chiny	0.04%
Ponadnarodowe	0.04%
Meksyk	0.03%
Razem	83.96%

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Ekonomiczna klasyfikacja inwestycji na dzień 30 czerwca 2021 r.

	% WAN
Skarb państwa	46.51%
Banki	9.53%
Fundusze inwestycyjne	9.49%
Zróżnicowane usługi finansowe	1.72%
Energetyka	1.54%
Fundusze REIT	1.29%
Nieruchomości	1.24%
Ropa naftowa i gaz	1.14%
Branża motoryzacyjna	1.09%
Media	1.04%
Przemysł farmaceutyczny	0.90%
Zakwaterowanie	0.83%
Półprzewodniki	0.69%
Usługi komercyjne	0.63%
Telekomunikacja	0.60%
Linie lotnicze	0.47%
Internet	0.43%
Produkty ochrony zdrowia	0.40%
Handel detaliczny	0.35%
Czas wolny / Rekreacja	0.34%
Rurociągi	0.32%
Instytucje oszczędnościowo-kredytowe	0.32%
Ubezpieczenia	0.28%
Przemysł spożywczy	0.27%
Gaz	0.24%
Oprogramowanie komputerowe	0.24%
Rolnictwo	0.22%
Elektronika	0.21%
Firmy inwestycyjne	0.21%
Usługi komunalne	0.21%
Części samochodowe i wyposażenie	0.20%
Przemysł chemiczny	0.15%
Komputery	0.15%
Napoje	0.12%
Wytwórczość różna	0.12%
Fundusze Private Equity	0.10%
Branża inżynierijno-budowlana	0.08%
Rozrywka	0.08%
Przemysł lotniczy i obronny	0.07%
Przemysł odzieżowy	0.07%
Materiały budowlane	0.06%
Branża biotechnologiczna	0.04%
Razem	83.96%

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER FUTURE WEALTH

Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2021 r.

Waluta	Ilość	Opis	Koszt USD	Wartość rynkowa USD	% WAN
Zbywalne papiery wartościowe dopuszczone do oficjalnego notowania na giełdzie lub znajdujące się w obrocie na innym rynku regulowanym - ogółem					
Obligacje					
Francja					
EUR	200,000	ORANGE SA CALLABLE MEDIUM TERM NOTE FIXED 0.750% 29/06/34	236,850.69	236,823.04	0.15%
Francja razem			236,850.69	236,823.04	0.15%
Obligacje razem			236,850.69	236,823.04	0.15%
Zbywalne papiery wartościowe dopuszczone do oficjalnego notowania na giełdzie lub znajdujące się w obrocie na innym rynku regulowanym					
Fundusze inwestycyjne					
Francja					
EUR	106,944	LYXOR NEW ENERGY UCITS ETF ETP EUR	5,120,841.54	5,269,574.16	3.39%
Francja razem			5,120,841.54	5,269,574.16	3.39%
Irlandia					
USD	486,900	ISHARES DIGITALISATION UCITS ETF ETP USD	5,173,101.64	5,455,714.50	3.51%
USD	648,512	ISHARES ELECTRIC VEHICLES & DRIVING TECHNOLOGY	5,029,904.08	5,276,942.14	3.40%
EUR	99,530	ISHARES GLOBAL TIMBER & FORESTRY UCITS ETF ETP GBP	3,091,685.56	3,094,815.48	1.99%
USD	603,681	ISHARES S&P 500 HEALTH CARE SECTOR UCITS ETF ETP	5,617,045.61	5,731,951.10	3.69%
USD	233,897	L&G CYBER SECURITY UCITS ETF ETP	5,737,776.14	5,972,559.90	3.84%
EUR	24,598	SPDR MSCI EUROPE HEALTH CARE UCITS ETF ETP EUR	5,009,435.23	5,134,055.20	3.31%
EUR	286,105	WELLINGTON FINTECH FUND OPEN-END FUND	5,402,368.99	5,607,777.69	3.61%
Irlandia razem			35,061,317.25	36,273,816.01	23.35%
Luksemburg					
EUR	377	ALLIANZ GLOBAL ARTIFICIAL INTELLIGENCE OPEN-END	1,223,956.41	1,293,092.13	0.83%
EUR	1,443	ALLIANZ GLOBAL ARTIFICIAL INTELLIGENCE OPEN-END	4,692,238.29	4,952,255.74	3.19%
EUR	34,993	AMUNDI INDEX MSCI WORLD UCITS ETF DR ETP EUR	3,566,651.24	3,659,477.15	2.36%
USD	10,300	AXA WORLD FUNDS - FRAMLINGTON ROBOTECH OPEN-END	2,554,142.56	2,649,154.71	1.71%
USD	9,379	AXA WORLD FUNDS - FRAMLINGTON ROBOTECH OPEN-END	2,339,332.19	2,412,275.36	1.55%
USD	64,764	BLACKROCK GLOBAL FUNDS - NEXT GENERATION	1,608,101.91	1,817,291.03	1.17%
USD	144,598	BLACKROCK GLOBAL FUNDS - NEXT GENERATION	3,863,065.24	4,057,407.53	2.61%
EUR	260,712	BNP PARIBAS EASY ECPI CIRCULAR ECONOMY LEADERS	4,222,760.18	4,515,240.78	2.91%
EUR	13,709	BNP PARIBAS FUNDS - AQUA OPEN-END FUND EUR	4,805,073.51	5,058,042.71	3.26%
EUR	3,492	BNP PARIBAS FUNDS ENERGY TRANSITION OPEN-END FUND	6,245,241.23	6,439,224.33	4.17%
EUR	2	CPR INVEST - GLOBAL SILVER AGE OPEN-END FUND EUR	380,476.01	379,005.88	0.24%
EUR	26	CPR INVEST - GLOBAL SILVER AGE OPEN-END FUND EUR	4,707,331.08	4,959,552.34	3.19%
USD	5,110	CREDIT SUISSE LUX DIGITAL HEALTH EQUITY FUND	5,872,292.72	6,089,695.32	3.92%
USD	313	CREDIT SUISSE LUX DIGITAL HEALTH EQUITY FUND	372,762.12	369,568.68	0.24%
EUR	40,183	EDMOND DE ROTHSCHILD FUND - BIG DATA OPEN-END FUND	5,040,348.23	5,025,465.83	3.24%
USD	176,041	GOLDMAN SACHS SICAV - GOLDMAN SACHS GLOBAL	5,951,794.84	6,267,069.75	4.03%
USD	187,778	INVESCO ASIA CONSUMER DEMAND FUND OPEN-END FUND	5,029,451.80	4,822,147.15	3.10%

Informacje dodatkowe stanowią integralną część niniejszych sprawozdań finansowych

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

EUR	15,163	JPMORGAN FUNDS - THEMATIC - GENETIC THERAPIES	2,054,589.11	2,076,245.23	1.34%
EUR	24,215	JPMORGAN FUNDS - THEMATIC - GENETIC THERAPIES	3,079,029.83	3,315,614.45	2.13%
USD	10,102	LYXOR MSCI WORLD INFORMATION TECHNOLOGY TR UCITS	5,412,301.59	5,764,150.69	3.71%
USD	51,003	MORGAN STANLEY INVESTMENT FUNDS - GLOBAL BRANDS	4,848,677.86	5,009,510.34	3.23%
EUR	111,397	NORDEA 1 SICAV - GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT	4,046,019.65	4,228,709.19	2.72%
EUR	12,072	PICTET - SECURITY OPEN-END FUND EUR	5,091,478.23	5,220,478.34	3.36%
USD	17,287	PICTET-SMARTCITY OPEN-END FUND USD	4,982,165.17	5,173,280.03	3.33%
EUR	12,428	ROBECO CAPITAL GROWTH FUNDS - ROBECOSAM	4,257,823.50	4,461,625.64	2.87%
EUR	10,345	ROBECO CAPITAL GROWTH FUNDS SICAV MUTUAL FUND EUR	5,207,276.54	5,412,798.25	3.48%
Luksemburg razem			<u>101,454,381.04</u>	<u>105,428,378.58</u>	<u>67.89%</u>
Fundusze inwestycyjne ogółem			<u>141,636,539.83</u>	<u>146,971,768.75</u>	<u>94.63%</u>
Inwestycje ogółem			<u>141,873,390.52</u>	<u>147,208,591.79</u>	<u>94.78%</u>

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER FUTURE WEALTH

Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2021 r.

Klasyfikacja geograficzna inwestycji na dzień 30 czerwca 2021 r.

	% WAN
Luksemburg	67.89%
Irlandia	23.35%
Francja	3.54%
Razem	94.78%

Ekonomiczna klasyfikacja inwestycji na dzień 30 czerwca 2021 r.

	% WAN
Fundusze inwestycyjne	94.63%
Telekomunikacja	0.15%
Total	94.78%

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2021 roku

Nota 1 – Informacje ogólne

SANTANDER SICAV („SICAV”) jest spółką utworzoną na mocy prawa obowiązującego w Luksemburgu, należąca do kategorii spółek inwestycyjnych o kapitale zmiennym (*société d’investissement à capital variable*), założoną w Luksemburgu na czas nieograniczony w formie spółki typu *société anonyme*, w dniu 27 października 1993 roku, zgodnie z postanowieniami znowelizowanej Ustawy o instytucjach zbiorowego inwestowania z dnia 30 marca 1988 roku oraz znowelizowanej Ustawy o spółkach handlowych z dnia 10 sierpnia 1915 roku. Od 2011 roku, SICAV podlega postanowieniom Rozdziału I znowelizowanej Ustawy z dnia 17 grudnia 2010 roku („Ustawa z 2010 roku”) odnoszącej się do Instytucji Zbiorowego Inwestowania w Zbywalne Papiery Wartościowe.

Statut Założycielski spółki został opublikowany w luksemburskim dzienniku urzędowym *Mémorial C., Recueil Spécial des Sociétés et Associations*, w dniu 27 listopada 1993 roku. Statut był następnie modyfikowany, po raz ostatni w dniu 30 maja 2014 roku, a zmiany zostały opublikowane w dzienniku urzędowym *Mémorial* w dniu 20 czerwca 2013 roku (pełny, ujednolicony tekst statutu przyjęty uchwałą Nadzwyczajnego Walnego Zgromadzenia Posiadaczy Tytułów w dniu 20 czerwca 2014 roku).

Rada Dyrektorów SICAV wyznaczyła Santander Asset Management Luxembourg S.A. jako Spółkę Zarządzającą SICAV w rozumieniu Rozdziału 15 Ustawy z 2010 roku. Santander Asset Management Luxembourg S.A. został założony 29 listopada 1996 roku jako spółka typu "société anonyme" zgodnie z prawem luksemburskim na czas nieokreślony. Jej siedziba urzędowa mieści się pod adresem 6, route de Trèves, L-2633 Senningerberg, Wielkie Księstwo Luksemburga. Statut został opublikowany po raz pierwszy w dniu 13 stycznia 1997 roku, a ostatnie zmiany wprowadzone zostały do Statutu w dniu 24 stycznia 2019 roku.

Spółka SICAV jest zarejestrowana w Luksemburskim Rejestrze Działalności Handlowej i Spółek (*Registre de Commerce et des Sociétés*) pod numerem B 45.337.

Rok finansowy spółki SICAV kończy się w dniu 31 grudnia każdego roku.

Celem SICAV jest zapewnienie inwestorom wyboru Subfunduszy inwestujących w podstawowe rodzaje papierów wartościowych, akcji i obligacji na całym świecie, z uwzględnieniem strategii ochrony i wzrostu kapitału oraz zgodnie z zasadą dywersyfikacji ryzyka.

W dniu 5 stycznia 2021 został zmieniony zarządzający subfunduszem SANTANDER SELECT INCOME z SANTANDER ASSET MANAGEMENT UK LIMITED na SANTANDER ASSET MANAGEMENT S.A., S.G.I.I.C.

W dniu 27 października 2020 roku Rada Dyrektorów SICAV postanowiła połączyć subfundusz SANTANDER AM AKCJI BRAZYLIJSKICH z subfunduszem SANTANDER AM SZANS INWESTYCYJNYCH AMERYKI ŁACIŃSKIEJ z terminem wejścia w życie 18 stycznia 2021 roku.

W dniu 27 października 2020 roku Rada Dyrektorów SICAV postanowiła połączyć subfundusz SANTANDER KRÓTKOTERMINOWYCH OBLIGACJI BRAZYLIJSKICH z subfunduszem SANTANDER GO ABSOLUTE RETURN z terminem wejścia w życie 18 stycznia 2021 roku.

W dniu 27 października 2020 roku Rada Dyrektorów SICAV postanowiła połączyć subfundusz SANTANDER SELECT TOTAL RETURN z subfunduszem SANTANDER OBLIGACJI KORPORACYJNYCH AMERYKI ŁACIŃSKIEJ z terminem wejścia w życie 18 stycznia 2021 roku.

W dniu 25 listopada 2020 roku Rada Dyrektorów SICAV podjęła decyzję o uruchomieniu Subfunduszu SANTANDER future wealth z datą wejścia w życie 26 stycznia 2021 roku.

W dniu 31 lipca 2020 roku Rada Dyrektorów SICAV podjęła decyzję o uruchomieniu Subfunduszu SANTANDER LATIN AMERICAN INVESTMENT GRADE ESG BOND z datą wejścia w życie 22 lutego 2019 roku.

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 31 grudnia 2021 (c.d.)

Zgodnie ze statutem założycielskim SICAV, Rada Dyrektorów może podjąć decyzję o wyemitowaniu w ramach każdego Subfunduszu odrębnych klas tytułów uczestnictwa (zwanymi w dalszej części dokumentu, odpowiednio, „Klasą” lub „Klasami”). Klasy Tytułów Uczestnictwa aktualnie wyemitowane przez SICAV (Klasa A, Klasa AD, Klasa AE, Klasa AEH denominowane w EUR, Klasa B, Klasa BD, Klasa BE i Klasa BEH denominowane w EUR, Klasa CDE, denominowana w EUR, Klasa I, Klasa IE i Klasa IEH denominowane w EUR, Klasa M, Klasa ME, Klasa MEH i Klasa MD denominowane w EUR, Klasa SE denominowana w EUR, Klasa XE denominowana w EUR, Klasa AU i Klasa AUH denominowane w USD, Klasa BUH denominowana w USD, Klasa M denominowana w USD, Klasa V denominowana w USD, Klasa C i Klasa CD denominowane w USD, Klasa D denominowana w USD, Klasa I i Klasa ID denominowane w USD, Klasa X denominowana w USD, Klasa IKP denominowana w GBP oraz Klasa RKP denominowana w GBP) mogą różnić się strukturą kosztów zbycia i umorzenia, strukturą opłat, opłatą za zarządzanie inwestycjami, walutą, minimalną wartością zlecenia nabycia, polityką dystrybucyjną, polityką hedgingową, grupą docelową inwestorów oraz opłatą za uzyskane wyniki.

Obok klas tytułów wyemitowanych w walucie referencyjnej danego Subfunduszu, klasy mogą być także dostępne w następujących walutach (skrót waluty jest dodawany do nazwy danej klasy):

- Euro (skrót E),
- Japoński jen (skrót J),
- Dolar amerykański (skrót U),
- Funt brytyjski (skrót P).

O ile Załączniki do Prospektu dotyczące poszczególnych Subfunduszy nie stanowią inaczej::

- Tytuły Uczestnictwa Klasy A mogą być nabywane wyłącznie przez inwestorów składających zlecenie nabycia o minimalnej wartości 500 EUR, 500 USD lub 1 000 GBP, zgodnie z walutą referencyjną Subfunduszu.
 - Tytuły Uczestnictwa Klasy AD mogą być nabywane wyłącznie przez inwestorów składających zlecenie nabycia o minimalnej wartości 500 EUR, 500 USD lub 1 000 GBP, zgodnie z walutą referencyjną Subfunduszu. W przypadku Tytułów Uczestnictwa Klasy AD zakłada się wypłatę dywidendy posiadaczom Tytułów Uczestnictwa tej klasy.
 - Tytuły Uczestnictwa Klasy B mogą być nabywane wyłącznie przez inwestorów składających zlecenie nabycia o minimalnej wartości 25 000 EUR lub 25 000 USD, zgodnie z walutą referencyjną Subfunduszu.
 - Tytuły Uczestnictwa Klasy BD mogą być nabywane wyłącznie przez inwestorów składających zlecenie nabycia o minimalnej wartości 25 000 EUR lub 25 000 USD zgodnie z walutą referencyjną Subfunduszu. W przypadku Tytułów Uczestnictwa Klasy BD zakłada się wypłatę dywidendy posiadaczom Tytułów Uczestnictwa tej klasy.
 - Tytuły Uczestnictwa Klasy C mogą być nabywane wyłącznie przez inwestorów składających zlecenie nabycia o minimalnej wartości 300 000 EUR lub 300 000 USD, zgodnie z walutą referencyjną Subfunduszu.
 - Tytuły Uczestnictwa Klasy CD mogą być nabywane wyłącznie przez inwestorów składających zlecenie nabycia o minimalnej wartości 300 000 EUR lub 300 000 USD, zgodnie z walutą referencyjną Subfunduszu. W przypadku Tytułów Uczestnictwa Klasy CD zakłada się wypłatę dywidendy posiadaczom Tytułów Uczestnictwa tej klasy.
 - Tytuły Uczestnictwa Klasy D mogą być nabywane wyłącznie przez inwestorów składających zlecenie nabycia o minimalnej wartości 25 000 GBP lub 25 000 USD zgodnie z walutą referencyjną Subfunduszu. W przypadku Tytułów Uczestnictwa Klasy D zakłada się wypłatę dywidendy posiadaczom Tytułów Uczestnictwa tej klasy.
 - Tytuły Uczestnictwa Klasy I mogą być nabywane wyłącznie przez inwestorów instytucjonalnych w rozumieniu Art. 174 znowelizowanej Ustawy z 2010 roku o przedsiębiorstwach zbiorowego inwestowania, składających zlecenie nabycia o minimalnej wartości 500 000 USD lub 500 000 EUR, zgodnie z walutą referencyjną Subfunduszu.
-

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2021 roku (c.d.)

- Tytuły Uczestnictwa Klasy ID mogą być nabywane wyłącznie przez inwestorów instytucjonalnych składających zlecenie nabycia o minimalnej wartości 500 000 USD lub 500 000 EUR, zgodnie z walutą referencyjną Subfunduszu. W przypadku Tytułów Uczestnictwa Klasy ID zakłada się wypłatę dywidendy posiadaczom Tytułów Uczestnictwa tej klasy.
 - Tytuły Uczestnictwa Klasy IK mogą być nabywane wyłącznie przez inwestorów instytucjonalnych składających zlecenie nabycia o minimalnej wartości 500 000 GBP lub 500 000 EUR, zgodnie z walutą referencyjną Subfunduszu. Rada Dyrektorów SICAV zamierza pozyskać certyfikację z brytyjskiego urzędu skarbowego aby w odniesieniu do tej Klasy uznać SICAV jako fundusz raportujący zagranicę („brytyjski status raportowania”).
 - Tytuły Uczestnictwa Klasy M mogą być nabywane wyłącznie przez inwestorów instytucjonalnych spełniających kryteria funduszu typu *feeder*, upoważnionych przez Radę Dyrektorów SICAV, w związku z tym dla tej Klasy Tytułów Uczestnictwa nie obowiązują minimalne wielkości zleceń nabycia. Walutą zleceń nabycia będzie EUR lub USD, zgodnie z walutą referencyjną Subfunduszu.
 - Tytuły Uczestnictwa Klasy MD mogą być nabywane wyłącznie przez inwestorów instytucjonalnych spełniających kryteria funduszu typu *feeder*, upoważnionych przez Radę Dyrektorów SICAV, w związku z tym dla tej Klasy Tytułów Uczestnictwa nie obowiązują minimalne wielkości zleceń nabycia. Walutą zleceń nabycia będzie EUR lub USD, zgodnie z walutą referencyjną Subfunduszu. W przypadku Tytułów Uczestnictwa Klasy MD zakłada się wypłatę dywidendy posiadaczom Tytułów Uczestnictwa tej klasy.
 - Tytuły Uczestnictwa Klasy RK mogą być nabywane wyłącznie przez inwestorów składających zlecenie nabycia o minimalnej wartości 500 GBP zgodnie z walutą referencyjną Subfunduszu. Rada Dyrektorów SICAV zamierza pozyskać certyfikację z brytyjskiego urzędu skarbowego aby w odniesieniu do tej Klasy uznać SICAV jako fundusz raportujący zagranicę („brytyjski status raportowania”).
 - Tytuły Uczestnictwa Klasy S mogą być emitowane według uznania Spółki Zarządzającej i mogą być nabywane wyłącznie przez inwestorów składających zapisy o minimalnej wartości wskazanej w odpowiednim Załączniku dotyczącym Subfunduszu. Tytuły Uczestnictwa Klasy S są zastrzeżone dla podmiotów świadczących niezależne usługi doradcze lub usługi dyskrejonaralnego zarządzania inwestycjami, lub dla innych dystrybutorów, którzy: (i) świadczą usługi inwestycyjne i prowadzą działalność inwestycyjną zgodnie z definicją zawartą w Dyrektywie 2014/65/UE w sprawie rynków instrumentów finansowych ("MiFID II"); oraz (ii) posiadają odrębne ustalenia dotyczące opłat dla swoich klientów w związku z tymi usługami i prowadzoną działalnością; oraz (iii) nie otrzymują żadnych innych opłat, rabatów ani płatności należnych z aktywów danego Subfunduszu w związku z tymi usługami i działalnością.
 - Tytuły uczestnictwa Klasy V mogą być nabywane wyłącznie przez inwestorów instytucjonalnych z siedzibą w Brazylii spełniających kryteria funduszu typu *feeder*, upoważnionych przez Radę Dyrektorów SICAV, w związku z tym dla tej Klasy Tytułów Uczestnictwa nie obowiązują minimalne wielkości zleceń nabycia. Dąży ona do systematycznego konwertowania wartości swoich aktywów netto na BRL poprzez wykorzystanie instrumentów pochodnych, w tym instrumentów terminowych niewymagających dostawy. Ponieważ BRL jest walutą podlegającą ograniczeniom, Tytuły Uczestnictwa Klasy V nie mogą być denominowane w BRL, dlatego będą one denominowane w Walucie Referencyjnej właściwego Subfunduszu. Ze względu na wykorzystanie walutowych instrumentów pochodnych, WAN na jeden Tytuł Uczestnictwa będzie zmieniać się zgodnie z wahaniami kursów wymiany pomiędzy BRL a Walutą Referencyjną Subfunduszu. Skutki tego będą odzwierciedlone w wynikach przedmiotowej Klasy Tytułów Uczestnictwa, które w związku z tym mogą znacząco różnić się od wyników innych Klas Tytułów Uczestnictwa w ramach danego Subfunduszu. Wszystkie zyski lub straty, jak również koszty i wydatki wynikające z tych transakcji będą wpływać wyłącznie na Wartość Aktywów Netto tej Klasy Tytułów Uczestnictwa.
 - Tytuły Uczestnictwa Klasy X mogą być nabywane wyłącznie przez jednostki Grupy Santander Asset Management i ich oddziały w każdym czasie po upoważnieniu przez Radę Dyrektorów. Dla tej Klasy Tytułów Uczestnictwa nie obowiązują minimalne wielkości zleceń nabycia.
 - Tytuły Uczestnictwa Klasy ZD mogą być nabywane wyłącznie przez inwestorów będących klientami Santander Consumer Bank AG działającymi jako dystrybutorzy i dokonującymi nabyć poprzez oficjalną aplikację online prowadzoną przez Santander Consumer Bank AG za minimum 25 EUR jako odpowiednik waluty referencyjnej subfunduszu. Z Tytułów Uczestnictwa Klasy ZD planowana jest wypłata dywidendy dla ich posiadaczy. Nie będzie pobierana opłata za zarządzanie od aktywów netto tej klasy Tytułów Uczestnictwa ze względu na specyficzną strukturę pobierania opłat w ich przypadku. Spółka Zarządzająca
-

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2021 roku (c.d.)

będzie w zamian opłacana za swoje usługi z opłat pobieranych przez Santander Consumer Bank AG od inwestorów zgodnie z metodologią i warunkami płatności jakie mogą zostać uzgodnione pomiędzy firmą zarządzającą i Santander Consumer Bank AG. Spółka Zarządzająca pozostanie odpowiedzialna za opłacanie kosztów Zarządzającego Aktywami.

W przypadku gdy jest oferowana w walucie innej niż waluta referencyjna danego Subfunduszu, waluta Klasy Tytułów Uczestnictwa może być zabezpieczona do waluty referencyjnej. Klasa Tytułów Uczestnictwa zostanie oznaczona wtedy przez wstawienie skrótu H w odpowiedniej nazwie Klasy Tytułów Uczestnictwa.

Na dzień 30 czerwca 2021 roku, oferta obejmowała emisję i sprzedaż Tytułów Uczestnictwa następujących Subfunduszy:

- SANTANDER GO KRÓTKOTERMINOWYCH PAPIERÓW WARTOŚCIOWYCH USD (denominowany w USD)

*Klasa A

*Klasa B

*Klasa BE

*Klasa I

*Klasa S (utworzona 8 kwietnia 2021 r.)

- SANTANDER OBLIGACJI KORPORACYJNYCH AMERYKI ŁACIŃSKIEJ (denominowany w USD)

*Klasa A

*Klasa AD

*Klasa AE (denominowana w EUR)

*Klasa AEH (denominowana w EUR)

*Klasa I

*Klasa ID

*Klasa RKP (denominowana w GBP)

*Klasa V

- SANTANDER AM SZANS INWESTYCYJNYCH AKCJI EUROPEJSKICH (denominowany w EUR)

*Klasa A

*Klasa B

- SANTANDER GO AKCJI PÓŁNOCNOAMERYKAŃSKICH (denominowany w USD)

*Klasa A

*Klasa B

*Klasa BEH (denominowana w EUR)

*Klasa C

*Klasa I

*Klasa M

*Klasa ME (denominowana w EUR)

*Klasa RKP (utworzona 28 stycznia 2021 r.) (denominowana w GBP)

*Klasa SE (denominowana w EUR)

*Klasa V

- SANTANDER EUROPEJSKICH SPÓŁEK DYWIDENDOWYCH (denominowany w EUR)

*Klasa A

*Klasa AD

*Klasa AU (denominowana w USD)

*Klasa B

*Klasa BUH (denominowana w USD)

*Klasa I

- SANTANDER AM OBLIGACJI AMERYKI ŁACIŃSKIEJ (denominowany w USD)

*Klasa A

*Klasa AE (denominowana w EUR)

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2021 roku (c.d.)

- *Klasa B
 - *Klasa D
 - *Klasa I

 - SANTANDER AM EUROPEJSKICH OBLIGACJI KORPORACYJNYCH (denominowany w EUR)
 - *Klasa A
 - *Klasa AD
 - *Klasa B
 - *Klasa BD
 - *Klasa I

 - SANTANDER AM AKCJI EUROPEJSKICH (denominowany w EUR)
 - *Klasa A
 - *Klasa AU (denominowana w USD)
 - *Klasa B
 - *Klasa I
 - *Klasa IKP (denominowana w GBP)
 - *Klasa M

 - SANTANDER AM SZANS INWESTYCYJNYCH AKCJI AMERYKI ŁACIŃSKIEJ (denominowany w USD)
 - *Klasa A
 - *Klasa AE (utworzona 18 stycznia 2021 r.) (denominowana w EUR)
 - *Klasa B
 - *Klasa I
 - *Klasa IE (denominowana w EUR)
 - *Klasa RKP (utworzona 28 stycznia 2021 r.) (denominowana w GBP)

 - SANTANDER AKTYWNEGO PORTFELA 1 (denominowany w USD)
 - *Klasa A
 - *Klasa AE (denominowana w EUR)
 - *Klasa B

 - SANTANDER AKTYWNEGO PORTFELA 2 (denominowany w USD)
 - *Klasa A
 - *Klasa AE (denominowana w EUR)
 - *Klasa B

 - SANTANDER KUPONU OBLIGACJI KORPORACYJNYCH (denominowany w USD)
 - *Klasa AD
 - *Klasa CD
 - *Klasa CDE (denominowana w EUR)

 - SANTANDER SELECT DEFENSYWNY (denominowany w EUR)
 - *Klasa A
 - *Klasa AUH (denominowana w USD)

 - SANTANDER SELECT STABILNY (denominowany w EUR)
 - *Klasa A
 - *Klasa AUH (denominowana w USD)

 - SANTANDER SELECT DYNAMICZNY (denominowany w EUR)
 - *Klasa A
 - *Klasa AUH (denominowana w USD)
-

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2021 roku (c.d.)

- SANTANDER MULTI INDEX SUBSTANCE (denominowany w EUR)

*Klasa A

- SANTANDER MULTI INDEX BALANCE (denominowany w EUR)

*Klasa A

- SANTANDER MULTI INDEX AMBITION (denominowany w EUR)

*Klasa A

- SANTANDER SELECT INCOME (denominowany w EUR)

*Klasa AD

*Klasa MD

- SANTANDER GO ABSOLUTE RETURN (denominowany w EUR)

*Klasa A

*Klasa B

*Klasa BUH (denominowana w USD)

*Klasa I

*Klasa M

*Klasa RKP (utworzona 28 stycznia 2021 r.) (denominowana w GBP)

SANTANDER GO GLOBALNYCH AKCJI ESG (denominowany w USD)

*Klasa A

*Klasa AE (denominowana w EUR)

*Klasa B

*Klasa BE (denominowana w EUR)

*Klasa BEH (denominowana w EUR)

*Klasa I

*Klasa IKP (denominowana w GBP)

*Klasa M

*Klasa RKP (denominowana w GBP)

*Klasa SE (utworzona 15 czerwca 2021 r.) (denominowana w EUR)

*Klasa V

SANTANDER COVERED BOND (denominowany w EUR)

*Klasa B

*Klasa I

SANTANDER GO DYNAMIC BOND (denominowany w USD)

*Klasa A

*Klasa B

*Klasa BEH (denominowana w EUR)

*Klasa I

*Klasa IEH (denominowana w EUR)

*Klasa M

*Klasa MEH (utworzona 25 stycznia 2021 r.) (denominowana w EUR)

*Klasa RKP (utworzona 28 stycznia 2021 r.) (denominowana w GBP)

SANTANDER LATIN AMERICAN INVESTMENT GRADE ESG BOND (denominowany w USD) (utworzony 22 lutego 2021 r.)

*Klasa A (utworzona 23 marca 2021 r.)

*Class I (utworzona 22 lutego 2021 r.)

SANTANDER FUTURE WEALTH (denominowany w USD) (utworzony 26 stycznia 2021 r.)

*Klasa A (utworzona 26 stycznia 2021 r.)

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2021 roku (c.d.)

- *Class AE (denominowana w EUR) (utworzona 26 stycznia 2021 r.)
- *Class M (utworzona 1 czerwca 2021 r.)
- *Class RKP (denominowana w GBP) (utworzona 28 stycznia 2021 r.)
- *Class V (utworzona 17 czerwca 2021 r.)
- *Class X (utworzona 17 czerwca 2021 r.)
- *Class XE (denominowana EUR) (utworzona 20 maja 2021 r.)

Zgodnie z postanowieniami Statutu Założycielskiego SICAV, Rada Dyrektorów może tworzyć dodatkowe Subfundusze, które mogą być denominowane w różnych walutach, a w obrębie każdego Subfunduszu może tworzyć odrębne klasy tytułów uczestnictwa, pod warunkiem zgodności z obowiązującymi limitami.

Posiadacze Tytułów Uczestnictwa mogą dokonywać zamiany tytułów uczestnictwa dowolnego Subfunduszu na tytuły uczestnictwa innego dostępnego Subfunduszu, zgodnie z zasadami wyszczególnionymi w Prospekcie.

Nota 2 – Dystrybucja dywidendy

Rada Dyrektorów SICAV postanowiła w dniu 9 czerwca 2021 roku o wypłaceniu w dniu 29 czerwca 2021 roku zaliczki na poczet dywidendy w następującej wysokości:

- SANTANDER OBLIGACJI KORPORACYJNYCH AMERYKI ŁACIŃSKIEJ
 - *Klasa AD: 2.451084 USD
- SANTANDER AM OBLIGACJI AMERYKI ŁACIŃSKIEJ
 - *Klasa D: 1.308685 USD
- SANTANDER KUPONU OBLIGACJI KORPORACYJNYCH
 - *Klasa AD: 1.221365 USD
 - *Klasa CD: 1.255984 USD
 - *Klasa CDE: 1.272351 EUR

Nota 3 – Podstawowe zasady rachunkowości

Walutą sprawozdawczą SICAV jest EUR.

Sprawozdania finansowe SICAV zostały sporządzone zgodnie z wymaganiami prawnymi i regulacyjnymi obowiązującymi w Luksemburgu, mającymi zastosowanie do Instytucji Zbiorowego Inwestowania w zbywalne papiery wartościowe, zgodnie z politykami rachunkowymi powszechnie stosowanymi w Luksemburgu, w tym z następującymi istotnymi zasadami rachunkowości:

3.1 Wycena aktywów inwestycyjnych

- każdy papier wartościowy oraz/ lub instrument rynku pieniężnego notowany lub będący przedmiotem obrotu na giełdzie zostanie wyceniony po najnowszej dostępnej cenie na zamknięcie sesji, a w uzasadnionych przypadkach, po średniej cenie rynkowej na giełdzie będącej głównym rynkiem dla takiego papieru wartościowego lub instrumentu rynku pieniężnego. Każdy papier wartościowy oraz/ lub instrument rynku pieniężnego będący przedmiotem obrotu na innym rynku regulowanym zostanie wyceniony w sposób jak najbliższy metodzie stosowanej dla notowanych papierów wartościowych.
 - wartość papierów wartościowych oraz/lub instrumentów rynku pieniężnego nienotowanych i niebędących przedmiotem obrotu na giełdzie ani na innym rynku regulowanym oraz papierów wartościowych i instrumentów rynku pieniężnego notowanych lub będących przedmiotem obrotu na giełdzie lub na innym rynku regulowanym, dla których nie są dostępne
-

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2021 roku (c.d.)

aktualne notowania, lub aktualne notowania nie odzwierciedlają godziwej wartości rynkowej, będzie ustalana z należytą ostrożnością i w dobrej wierze przez Radę Dyrektorów SICAV, na podstawie możliwych do przewidzenia cen sprzedaży.

- tytuły uczestnictwa lub jednostki uczestnictwa bazowych otwartych funduszy inwestycyjnych będą wyceniane po ostatniej dostępnej obliczonej wartości aktywów netto.

Środki pieniężne i inne aktywa płynne są wyceniane według wartości nominalnej z uwzględnieniem naliczonych odsetek.

3.2 Zrealizowany dochód/strata netto z tytułu sprzedaży inwestycji

Zrealizowany zysk lub strata netto na sprzedaży inwestycji są ustalane w oparciu o średni koszt sprzedanych inwestycji i prezentowane w Zestawieniu operacji i zmian stanu aktywów netto.

3.3 Waluty obce

Skonsolidowane sprawozdania finansowe SICAV

Poszczególne pozycje skonsolidowanego zestawienia aktywów netto oraz skonsolidowanego zestawienia operacji i zmian w kapitale SICAV na dzień 30 czerwca 2021 roku są równe łącznej sumie odpowiednich pozycji sprawozdań finansowych każdego z Subfunduszy, przeliczonych na EUR według kursu wymiany obowiązującego na dzień 30 czerwca 2021 roku.

Transakcje walutowe

Aktywa i pasywa denominowane w walutach innych niż waluta Subfunduszu są przeliczane na walutę Subfunduszu po kursach obowiązujących na dzień 30 czerwca 2021 roku. Dochody i wydatki w walutach innych niż waluta Subfunduszu są przeliczane na walutę Subfunduszu po kursach obowiązujących w dniu transakcji.

Zrealizowane zyski i straty netto i zmiany w niezrealizowanych netto zyskach/stratach z różnic kursowych są wykazane w zestawieniu operacji i zmian w aktywach netto.

Kursy głównych walut obowiązujące na dzień 30 czerwca 2021 roku:

1 EUR = 0.858446 GBP
1 EUR = 1.185900 USD

3.4 Wycena kontraktów walutowych forward

Nierozliczone terminowe kontrakty walutowe są wyceniane na podstawie terminowych kursów wymiany obowiązujących na dany dzień wyceny, a zrealizowane zyski i straty netto i zmiany w niezrealizowanych netto zyskach i stratach są wykazywane w skonsolidowanym zestawieniu operacji i zmian w stanie aktywach netto.

3.5 Wycena kontraktów terminowych futures

Kontrakty futures są wyceniane w oparciu o najbardziej aktualną cenę dostępną na danym rynku na dzień wyceny a zrealizowane netto i zmiany w niezrealizowanych netto zyskach i stratach są zawarte w sprawozdaniu z operacji i zmianach w aktywach netto.

3.6 Wycena opcji

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2021 roku (c.d.)

Wartość rozliczeniowa opcji będących w obrocie na rynkach giełdowych oparta jest na cenie na zamknięcie sesji publikowanej przez giełdy po jakiej Subfundusz zawarł kontrakty. Wartość rozliczeniowa opcji niebędących w obrocie na rynkach giełdowych ustalana jest zgodnie z zasadami wyceny określonymi przez Radę Dyrektorów SICAV według jednolitych kryteriów dla każdego rodzaju kontraktów.

Zrealizowane netto i zmiany w niezrealizowanych netto zyskach i stratach oraz zmiana w niezrealizowanych zyskach i stratach wykazane są w Zestawieniu operacji i zmian w aktywach netto.

3.7 Wycena kontraktów swap stóp procentowych

Kontrakt swap stóp procentowych jest umową dwustronną, w której każda ze stron zgadza się na wymianę serii płatności odsetkowych na inną serię płatności odsetkowych (zwykle stałą / zmienną) w oparciu o kwotę nominalną, która służy jako podstawa obliczeń i która zwykle nie jest wymienna.

Zrealizowany zysk lub strata netto oraz zmiana niezrealizowanego zysku lub straty netto są wykazane w Zestawieniu operacji i zmian w aktywach netto.

3.8 Wycena kontraktów swap ryzyka kredytowego

Kontrakt swap ryzyka kredytowego to kredytowa transakcja pochodna, w której dwie strony zawierają umowę, na mocy której jedna strona płaci drugiej okresowo stały kupon przez określony czas trwania umowy. Druga strona nie dokonuje żadnych płatności, chyba że wystąpi zdarzenie kredytowe związane z określonym z góry aktywem referencyjnym. W przypadku wystąpienia takiego zdarzenia druga strona dokonuje płatności na rzecz pierwszej strony, a kontrakt swap ulega rozwiązaniu. Wartość bazowych papierów wartościowych jest brana pod uwagę przy obliczaniu zdolności inwestycyjnych i kredytowych poszczególnych emitentów.

Zrealizowany zysk lub strata netto oraz zmiana niezrealizowanego zysku lub straty netto są wykazane w Zestawieniu operacji i zmian w aktywach netto.

3.9 Koszty organizacyjne

Koszty organizacyjne są kapitalizowane i amortyzowane na zasadach amortyzacji liniowej przez okres pięciu lat.

3.10 Ujmowanie dochodu

Dywidendy, pomniejszone o bezzwrotny podatek u źródła, są uwzględniane w dochodach na dzień pierwszego notowania papierów wartościowych bez prawa do dywidendy. Dochód odsetkowy jest naliczany w trybie dziennym.

3.11 Rozliczenia międzyokresowe kosztów

Rozliczenia międzyokresowe kosztów są wykazane w Zestawieniu aktywów netto do momentu zużycia przedpłaconej pozycji. W takim przypadku przedpłacony wydatek zostaje usunięty z zestawienia aktywów netto i zamiast tego zostaje zaraportowany w tym okresie jako wydatek w rachunku zysków i strat.

3.12 Wycena należności z tytułu umów z przyrzeczeniem odkupu

Umowa z przyrzeczeniem odkupu (*reverse repo*) to umowa, na mocy której w zamian za określoną kwotę SICAV otrzymuje (nabywa) zbywalne papiery wartościowe od kontrahenta, który zobowiązuje się do ich odkupienia po cenie i terminie określonym przez obie strony w momencie zawarcia umowy. Umowa z przyrzeczeniem odkupu jest podobna w swoich skutkach do pożyczki udzielonej kontrahentowi przez SICAV, przy czym pożyczka taka jest zabezpieczona zbywalnymi papierami wartościowymi. Spółka SICAV rozlicza umowę odkupu tak, jakby była to pożyczka i wykazuje ją w zestawieniu aktywów netto w pozycji "Należności z tytułu umów z przyrzeczeniem odkupu"/ "Zobowiązania z tytułu umów z przyrzeczeniem odkupu". Umowa z przyrzeczeniem odkupu jest z reguły krótkoterminowa i nie podlega przeniesieniu. SICAV wycenia ten rodzaj umowy według kosztu, który w połączeniu z narosłymi odsetkami stanowi przybliżoną wartość, za jaką papiery wartościowe zostaną odkupione przez kontrahenta

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2021 roku (c.d.)

3.13 Wycena swapów total return

Swap total return to umowa dwustronna, w której każda ze stron zgadza się na wymianę płatności w oparciu o wyniki instrumentu bazowego reprezentowanego przez papier wartościowy, towar, koszyk lub indeks za stałą lub zmienną stawkę. Jedna ze stron wypłaca całkowity zwrot z określonego składnika aktywów referencyjnych, a druga otrzymuje regularny strumień płatności. Całkowite wyniki będą obejmować zyski i straty z tytułu instrumentu bazowego, a także wszelkie odsetki lub dywidendy w okresie obowiązywania umowy w zależności od rodzaju instrumentu bazowego. Przepływy pieniężne podlegające wymianie są obliczane przez odniesienie się do uzgodnionej kwoty lub ilości referencyjnej. W zakresie, w jakim całkowity zwrot z aktywów stanowiących podstawę transakcji przekracza lub nie jest wystarczający do płatności kompensacyjnej, SICAV otrzymuje płatność od lub dokonuje płatności na rzecz kontrahenta.

Zrealizowany zysk lub strata netto oraz zmiana niezrealizowanego zysku lub straty netto są wykazane w Zestawieniu operacji i zmian w aktywach netto.

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2021 roku (c.d.)

Nota 4 - Prowizje od zleceń nabycia i umorzenia

Tytuły uczestnictwa SANTANDER SICAV są emitowane w oparciu o wartość aktywów netto, do której może zostać dodana ewentualna opłata dystrybucyjna nie przekraczająca 5%, płacona na rzecz pośrednika biorącego udział w dystrybucji tytułów uczestnictwa dla następujących Subfunduszy:

- SANTANDER GO KRÓTKOTERMINOWYCH PAPIERÓW WARTOŚCIOWYCH USD,
- SANTANDER OBLIGACJI KORPORACYJNYCH AMERYKI ŁACIŃSKIEJ,
- SANTANDER AM SZANS INWESTYCYJNYCH AKCJI EUROPEJSKICH,
- SANTANDER GO AKCJI PÓŁNOCNOAMERYKAŃSKICH ,
- SANTANDER EUROPEJSKICH SPÓŁEK DYWIDENDOWYCH,
- SANTANDER AM EUROPEJSKICH OBLIGACJI KORPORACYJNYCH,
- SANTANDER AM AKCJI EUROPEJSKICH,
- SANTANDER AM SZANS INWESTYCYJNYCH AKCJI AMERYKI ŁACIŃSKIEJ,
- SANTANDER SELECT DEFENSYWNY,
- SANTANDER SELECT STABILNY,
- SANTANDER SELECT DYNAMICZNY,
- SANTANDER MULTI INDEX SUBSTANCE,
- SANTANDER MULTI INDEX BALANCE,
- SANTANDER MULTI INDEX AMBITION,
- SANTANDER SELECT INCOME,
- SANTANDER SELECT TOTAL RETURN,
- SANTANDER GO ABSOLUTE RETURN,
- SANTANDER GO GLOBALNYCH AKCJI ESG,
- SANTANDER COVERED BOND,
- SANTANDER GO DYNAMIC BOND
- SANTANDER LATIN AMERICAN INVESTMENT GRADE ESG BOND (utworzony 22 lutego 2021 r.),
- - SANTANDER FUTURE WEALTH (utworzony 26 stycznia 2021 r.).

Pierwsze 3% prowizji za nabycie płacone jest na rzecz Subfunduszy, a saldo powyżej 3% na rzecz Spółki Zarządzającej.

Tytuły uczestnictwa SICAV są emitowane po ich wartości aktywów netto, do której może zostać dodana opłata za sprzedaż nieprzekraczająca 2%, zapłacona (jeżeli ma zastosowanie) i należna pośrednikowi działającemu w związku z dystrybucją, w odniesieniu do:

- SANTANDER AM OBLIGACJI AMERYKI ŁACIŃSKIEJ.

Tytuły uczestnictwa SICAV są umarzone w oparciu o ich WAN, od której potrącona może zostać prowizja za umorzenie nie przekraczająca 1% dla następujących Subfunduszy:

- SANTANDER GO KRÓTKOTERMINOWYCH PAPIERÓW WARTOŚCIOWYCH USD,
 - SANTANDER OBLIGACJI KORPORACYJNYCH AMERYKI ŁACIŃSKIEJ,
 - SANTANDER AM SZANS INWESTYCYJNYCH AKCJI EUROPEJSKICH,
 - SANTANDER GO AKCJI PÓŁNOCNOAMERYKAŃSKICH ,
 - SANTANDER EUROPEJSKICH SPÓŁEK DYWIDENDOWYCH,
 - SANTANDER AM OBLIGACJI AMERYKI ŁACIŃSKIEJ,
 - SANTANDER AM EUROPEJSKICH OBLIGACJI KORPORACYJNYCH,
 - SANTANDER AM AKCJI EUROPEJSKICH,
 - SANTANDER AM SZANS INWESTYCYJNYCH AKCJI AMERYKI ŁACIŃSKIEJ,
 - SANTANDER SELECT DEFENSYWNY,
 - SANTANDER SELECT STABILNY,
 - SANTANDER SELECT DYNAMICZNY,
 - SANTANDER MULTI INDEX SUBSTANCE,
 - SANTANDER MULTI INDEX BALANCE,
 - SANTANDER MULTI INDEX AMBITION,
 - SANTANDER SELECT INCOME,
-

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2021 roku (c.d.)

- SANTANDER SELECT TOTAL RETURN,
- SANTANDER GO ABSOLUTE RETURN,
- SANTANDER GO GLOBALNYCH AKCJI ESG,
- SANTANDER COVERED BOND,
- SANTANDER GO DYNAMIC BOND
- SANTANDER LATIN AMERICAN INVESTMENT GRADE ESG BOND (utworzony 22 lutego 2021 r.),
- - SANTANDER FUTURE WEALTH (utworzony 26 stycznia 2021 r.).

Pierwsze 3% prowizji za umorzenie płacone jest na rzecz Subfunduszy, a saldo powyżej 3% na rzecz Spółki Zarządzającej.



SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Nota 5 – Opłaty za zarządzanie

W zamian za świadczone usługi, Spółka Zarządzająca otrzymuje od SICAV opłatę serwisową w wysokości 0,03% rocznie średniej wartości aktywów każdego Subfunduszu SICAV oraz Opłatę za Zarządzanie uiszczaną miesięcznie, za każdy zakończony miesiąc, naliczaną na każdy Dzień Wyceny zgodnie z postanowieniami Prospektu SICAV od średniej wartości aktywów netto każdego Subfunduszu SICAV według stopy rocznej wskazanej poniżej. W odniesieniu do inwestycji subfunduszu w jednostki UCITS / UCI całościowa opłata za zarządzanie (wyłączając wszelkie opłaty za wyniki) pobierana z takiego subfunduszu oraz UCITS / UCI nie może przekroczyć stawki 3,5% odpowiednich aktywów.

SANTANDER GO KRÓTKOTERMINOWYCH PAPIERÓW WARTOŚCIOWYCH USD

- 0.70% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy A
- 0.40% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy B
- 0.40% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy BE
- 0.15% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy I
- 0.15% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy S

SANTANDER OBLIGACJI KORPORACYJNYCH AMERYKI ŁACIŃSKIEJ

- 1.75% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy A
- 1.75% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy AD
- 1.20% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy AE i Klasa AEH
- 0.60% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy I i Klasa ID
- 0.60% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy RKP
- 0.34% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy V

SANTANDER AM SZANS INWESTYCYJNYCH AKCJI EUROPEJSKICH

- 2.00% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy A
- 1.50% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy B
- 0.60% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy I

SANTANDER GO AKCJI PÓŁNOCNOAMERYKAŃSKICH

- 2.00% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy A
- 1.30% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy B
- 1.30% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy BEH
- 1.40% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy C
- 0.60% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy I
- 0.45% za Tytuły Uczestnictwa Klasy M
- 0.45% za Tytuły Uczestnictwa Klasy ME
- 0.60% za Tytuły Uczestnictwa Klasy RKP
- 0.53% (0,65% do 31 marca 2021) za Tytuły Uczestnictwa Klasy SE
- 0.45% za Tytuły Uczestnictwa Klasy V

SANTANDER EUROPEJSKICH SPÓŁEK DYWIDENDOWYCH

- 2.00% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy A
- 1.75% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy AD
- 2.00% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy AU
- 1.50% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy B
- 1.50% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy BUH
- 0.60% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy I

SANTANDER AM OBLIGACJI AMERYKI ŁACIŃSKIEJ

- 1.75% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy A i Klasa AE
- 0.70% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy B
- 0.70% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy D
- 0.60% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy I

SANTANDER AM EUROPEJSKICH OBLIGACJI KORPORACYJNYCH

- 1.00% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy A
-

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

- 1.00% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy AD
- 0.75% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy B
- 0.75% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy BD
- 0.50% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy I

SANTANDER AM AKCJI BRAZYLIJSKICH

- 2.00% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy A i Klasa AE (ostatni raz wartość aktywów netto obliczono na dzień 18 stycznia 2021)
- 1.50% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy B (ostatni raz wartość aktywów netto obliczono na dzień 18 stycznia 2021)

SANTANDER BRAZYLIJSKICH KRÓTKOTERMINOWYCH PAPIERÓW WARTOŚCIOWYCH (połączenie z datą wejścia w życie 18 stycznia 2021)

- 1.75% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy A i Klasa AE (ostatni raz wartość aktywów netto obliczono na dzień 18 stycznia 2021)

SANTANDER AM AKCJI EUROPEJSKICH

- 2.00% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy A
- 2.50% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy AU
- 1.50% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy B
- 0.60% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy I
- 0.25% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy IKP
- 0.05% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy M

SANTANDER AM SZANS INWESTYCYJNYCH AKCJI AMERYKI ŁACIŃSKIEJ

- 1.75% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy A
- 1.55% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy AE
- 1.50% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy B
- 0.70% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy I i Klasy IE
- 0.70% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy RKP

SANTANDER AKTYWNEGO PORTFELA 1

- 1.50% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy A i Klasy AE
- 1.00% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy B

SANTANDER AKTYWNEGO PORTFELA 2

- 1.50% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy A i Klasy AE
- 1.00% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy B

SANTANDER KUPONU OBLIGACJI KORPORACYJNYCH

- 1.75% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy AD
- 1.25% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy CD i Klasy CDE

SANTANDER SELECT DEFENSYWNY

- 1.25% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy A
- 1.25% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy AUH

SANTANDER SELECT STABILNY

- 1.50% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy A
- 1.50% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy AUH

SANTANDER SELECT DYNAMICZNY

- 1.75% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy A
- 1.75% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy AUH

SANTANDER MULTI INDEX SUBSTANCE

- 0.95% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy A
-

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER MULTI INDEX BALANCE

- 0.95% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy A

SANTANDER MULTI INDEX AMBITION

- 0.95% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy A

SANTANDER SELECT INCOME

- 1.50% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy AD
- 0.23% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy MD

SANTANDER SELECT TOTAL RETURN (połączenie z datą wejścia w życie dnia 18 stycznia 2021)

- 1.25% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy A

SANTANDER GO ABSOLUTE RETURN

- 1.50% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy A
- 1.00% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy B
- 1.00% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy BUH
- 0.55% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy I

SANTANDER GO GLOBALNYCH AKCJI ESG

- 1.60% za Tytuły Uczestnictwa Klasy A
- 1.60% za Tytuły Uczestnictwa Klasy AE
- 1.20% za Tytuły Uczestnictwa Klasy B
- 1.20% za Tytuły Uczestnictwa Klasy BE
- 1.20% za Tytuły Uczestnictwa Klasy BEH
- 0.60% za Tytuły Uczestnictwa Klasy I
- 0.45% za Tytuły Uczestnictwa Klasy M
- 0.60% za Tytuły Uczestnictwa Klasy IKP
- 0.60% za Tytuły Uczestnictwa Klasy RKP
- 0.60% za Tytuły Uczestnictwa Klasy SE
- 0.45% za Tytuły Uczestnictwa Klasy V

SANTANDER COVERED BOND

- 0.35% za Tytuły Uczestnictwa Klasy B
- do 0.10% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy I

SANTANDER GO DYNAMIC BOND

- 1.60% za Tytuły Uczestnictwa Klasy A
- 1.25% za Tytuły Uczestnictwa Klasy B
- 1.25% za Tytuły Uczestnictwa Klasy BEH
- 0.60% za Tytuły Uczestnictwa Klasy I
- 0.60% za Tytuły Uczestnictwa Klasy IEH
- 0.42% za Tytuły Uczestnictwa Klasy M i Klasy MEH
- 0.60% za Tytuły Uczestnictwa Klasy RKP

SANTANDER LATIN AMERICAN INVESTMENT GRADE ESG BOND (uruchomiony 22 lutego 2021)

- 1.20% za Tytuły Uczestnictwa Klasy A
- 0.50% za Tytuły Uczestnictwa Klasy I

SANTANDER FUTURE WEALTH (uruchomiony 26 stycznia 2021)

- 1.35% za Tytuły Uczestnictwa Klasy A i Klasy AE
 - 0.03% za Tytuły Uczestnictwa Klasy M
 - 0.03% za Tytuły Uczestnictwa Klasy RKP
 - 0.23% za Tytuły Uczestnictwa Klasy V
 - 0.23% za Tytuły Uczestnictwa Klasy X i Klasy XE
-

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Nota 6 - Zobowiązania z tytułu podatków i inne koszty

	SANTANDER GO AKCJI PÓŁNOCNO AMERYKAŃSKICH	SANTANDER AM AKCJI EUROPEJSKICH
	USD	EUR
Opłaty na rzecz depozytariusza (Nota 7)	13,429.70	5,144.87
Koszty administracyjne (Nota 7)	64,218.32	19,298.40
Podatek roczny (Nota 8)	55,345.49	13,553.40
Opłaty za zarządzanie (Nota 5)	1,099,197.18	145,082.17
Koszty audytu i prawne	773.43	9,919.45
Inne opłaty	78,778.58	64,289.46
	1,311,742.70	257,287.75

	SANTANDER GO GLOBALNYCH AKCJI ESG	SANTANDER GO DYNAMIC BOND
	USD	USD
Opłaty na rzecz depozytariusza (Nota 7)	4,115.24	13,695.42
Koszty administracyjne (Nota 7)	16,938.33	40,512.73
Podatek roczny (Nota 8)	8,747.71	7,510.16
Opłaty za zarządzanie (Nota 5)	192,400.82	175,574.38
Koszty audytu i prawne	1,157.90	671.44
Inne opłaty	10,306.03	9,855.13
	233,666.03	247,819.26

	SANTANDER FUTURE WEALTH
	USD
Opłaty na rzecz depozytariusza (Nota 7)	
Koszty administracyjne (Nota 7)	11,713.33
Podatek roczny (Nota 8)	18,566.93
Opłaty za zarządzanie (Nota 5)	150,232.15
Koszty audytu i prawne	86.80
Inne opłaty	5,870.16
	186,469.37

Nota nr 7 – Depozytariusz i koszty administracyjne

Jako Depozytariusz oraz Agent Administracyjny, Korporacyjny i Domicylacyjny J.P. MORGAN BANK LUXEMBOURG S.A. jest uprawniony do otrzymywania wynagrodzenia za świadczone usługi dla SICAV i Firmy Zarządzającej w postaci rocznej opłaty w zależności od charakteru inwestycji różnych subfunduszy w zakresie od 0,05% do 0,30% rocznie Wartości Aktywów Netto aktywów każdego subfunduszu. Opłata ta jest kalkulowana i naliczana w trybie dziennym i jest płacona w trybie miesięcznym depozytariuszowi przez SICAV. Należy zwrócić uwagę na fakt, iż minimalna opłata roczna za usługi administracyjne (15 000 EUR) i usługi powiernicze (9.200 EUR) jest płacona przez SICAV dla J.P. MORGAN BANK LUXEMBOURG S.A. jako wynagrodzenie za prowadzenie księgowości funduszu, wycenę i usługi powiernicze w przypadku gdy stawki opłat za te usługi (wyrażone w punktach bazowych rocznie) nie osiągną minimum rocznego. Opłaty administracyjne i powiernicze (stawka wyrażona w punktach bazowych z minimum rocznym) są kalkulowane i naliczane w Subfunduszach w trybie dziennym i płatne na rzecz Depozytariusza oraz Agentu Administracyjnego, Korporacyjnego i Domicylacyjnego w trybie miesięcznym.

Nota 8 – Podatek roczny

W świetle obecnie obowiązujących regulacji prawnych i stosowanej praktyki, SICAV nie podlega żadnemu opodatkowaniu dochodów ani dywidend u źródła, w Luksemburgu. Spółka SICAV zobowiązana jest jednak do zapłaty podatku rocznego w Luksemburgu (zwanego dalej „Podatkiem Subskrypcyjnym”), uiszczanego kwartalnie, w wysokości 0,05% wartości aktywów netto dla wszystkich Klas Tytułów Uczestnictwa na koniec danego kwartału, z wyjątkiem Klas Tytułów Uczestnictwa zastrzeżonych dla Inwestorów Instytucjonalnych, w przypadku których stawka Podatku Subskrypcyjnego

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

jest obniżona do 0,01% wartości aktywów netto. W każdym przypadku, z ogółu aktywów wyłączone są część aktywów netto posiadanych na ostatni dzień danego kwartału, reprezentowana przez jednostki lub tytuły uczestnictwa w innych instytucjach zbiorowego inwestowania w Luksemburgu, jeśli przedmiotowe jednostki lub tytuły uczestnictwa zostały już objęte Podatkiem Subskrypcyjnym, o którym mowa w znowelizowanej Ustawie z roku 2010 dotyczącej instytucji zbiorowego inwestowania, które są zwolnione z Podatku Subskrypcyjnego. Emisja Tytułów Uczestnictwa nie podlega opłacie skarbowej, ani żadnym innym podatkom obowiązującym na terytorium Luksemburga, za wyjątkiem podatku przewidzianego w przepisach prawnych Luksemburga, który został zapłacony na etapie zawiązywania spółki.

Zgodnie z aktualnie obowiązującymi przepisami prawa i praktykami podatkowymi, żaden podatek od zysków kapitałowych nie jest należny w Luksemburgu od zrealizowanego bądź niezrealizowanego wzrostu wartości aktywów SICAV.

Nota 9 – Lista zmian w portfelu

Kopię listy zmian w portfelu papierów wartościowych subfunduszy można uzyskać bezpłatnie w siedzibie urzędowej SICAV.

Nota 10 – Terminowe kontrakty walutowe

Na dzień 30 czerwca 2021 roku, Subfundusz SANTANDER GO AKCJI PÓŁNOCNOAMERYKAŃSKICH miał zawarte następujące terminowe kontrakty walutowe:

	Kupiona ilość		Sprzedana ilość	Data zapadalności	Niezrealizowany zysk USD	Druga strona kontraktu
USD	802,000.00	BRL	(3,964,422.34)	30/07/2021	14,243.81	JPMorgan Chase & Co.
USD	26,066.16	USD	(21,841.47)	30/07/2021	148.97	JPMorgan Chase & Co.
USD	14,922.10	USD	(12,478.11)	30/07/2021	115.52	JPMorgan Chase & Co.
				Razem	14,508.30	

	Kupiona ilość		Sprzedana ilość	Data zapadalności	Niezrealizowana (strata) USD	Druga strona kontraktu
EUR	96,824,162.51	USD	(115,252,221.24)	30/07/2021	(360,228.79)	JPMorgan Chase & Co.
BRL	422,641,404.69	USD	(84,039,172.95)	30/07/2021	(57,609.94)	JPMorgan Chase & Co.
BRL	13,997,728.45	USD	(2,831,003.80)	30/07/2021	(49,565.21)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	2,939,423.65	USD	(3,512,531.90)	30/07/2021	(24,598.40)	JPMorgan Chase & Co.
BRL	12,296,196.50	USD	(2,462,046.03)	30/07/2021	(18,712.77)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	91,550.00	USD	(109,006.39)	30/07/2021	(372.74)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	50,000.00	USD	(59,667.10)	30/07/2021	(336.87)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	65,000.00	USD	(77,426.44)	30/07/2021	(297.14)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	50,122.43	USD	(59,742.48)	30/07/2021	(266.98)	JPMorgan Chase & Co.
				Razem	(511,988.84)	

Na dzień 30 czerwca 2021 roku, Subfundusz SANTANDER GO GLOBALNYCH AKCJI ESG miał zawarte następujące terminowe kontrakty walutowe:

	Kupiona ilość		Sprzedana ilość	Data zapadalności	Niezrealizowana (strata) USD	Druga strona kontraktu
BRL	15,491,894.78	USD	(3,134,000.00)	30/07/2021	(55,660.96)	JPMorgan Chase & Co.
BRL	318,623,262.74	USD	(63,355,921.09)	30/07/2021	(43,431.31)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	11,406,468.90	USD	(13,577,405.09)	30/07/2021	(42,437.12)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	176,271.36	USD	(210,366.65)	30/07/2021	(1,202.25)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	102,843.52	USD	(122,582.38)	30/07/2021	(547.79)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	30,264.36	USD	(36,035.05)	30/07/2021	(123.22)	JPMorgan Chase & Co.
				Razem	(143,402.65)	

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Na dzień 30 czerwca 2020 roku, Subfundusz SANTANDER GO DYNAMIC BOND miał zawarte następujące terminowe kontrakty walutowe:

	Kupiona ilość		Sprzedana ilość	Data zapadalności	Niezrealizowany zysk USD	Dru ga strona kontraktu
USD	20,776,716.26	EUR	(17,104,000.00)	17/08/2021	473,601.32	Bank of America
USD	18,329,453.60	JPY	(2,000,000,000)	06/07/2021	309,297.60	Goldman Sachs Bank USA
USD	2,882,673.73	AUD	(3,692,000.00)	17/08/2021	110,322.73	BNP Paribas S.A.
BRL	9,918,063.40	USD	(1,868,213.15)	02/07/2021	108,343.22	Bank of America
USD	4,373,069.24	GBP	(3,111,000.00)	17/08/2021	74,897.24	State Street Bank and Trust
USD	1,336,046.00	ZAR	(18,336,696.93)	15/09/2021	64,373.64	Goldman Sachs Bank USA
USD	1,598,575.26	EUR	(1,317,000.00)	17/08/2021	35,244.91	Goldman Sachs Bank USA
USD	1,281,055.61	GBP	(908,000.00)	17/08/2021	26,558.61	State Street Bank and Trust
USD	816,216.32	ZAR	(11,390,000.00)	15/09/2021	26,305.89	Goldman Sachs Bank USA
MXN	11,707,000.00	USD	(557,176.38)	03/09/2021	26,135.86	Goldman Sachs Bank USA
USD	650,706.00	ZAR	(9,011,056.72)	15/09/2021	25,778.20	Goldman Sachs Bank USA
COP	5,208,260,520.00	USD	(1,366,922.17)	10/08/2021	25,032.33	Goldman Sachs Bank USA
USD	1,026,534.01	PEN	(3,847,757.44)	12/11/2021	19,833.91	Goldman Sachs Bank USA
PEN	1,710,553.50	USD	(429,733.32)	13/07/2021	16,980.07	Standard Chartered Bank London
USD	802,279.23	CAD	(973,000.00)	17/08/2021	16,537.47	MS (FX OPS) London
USD	622,972.47	EUR	(511,000.00)	17/08/2021	16,395.54	Barclays London
USD	595,290.00	GBP	(421,000.00)	17/08/2021	13,634.45	Bank of America
USD	480,621.20	EUR	(396,000.00)	17/08/2021	10,553.76	Goldman Sachs Bank USA
USD	304,871.85	EUR	(250,000.00)	17/08/2021	8,112.10	JPMorgan Bank, N.A. New York
USD	454,692.58	PEN	(1,710,553.50)	13/07/2021	7,979.19	Standard Chartered Bank London
USD	744,043.76	CLP	(538,352,866.00)	12/11/2021	7,733.70	JPMorgan Chase & Co.
USD	1,853,666.07	ILS	(6,001,800.00)	30/11/2021	7,691.48	JPMorgan Bank, N.A. New York
RUB	9,855,238.00	USD	(127,700.70)	22/07/2021	6,834.90	Goldman Sachs Bank USA
RUB	10,694,126.00	USD	(139,451.07)	22/07/2021	6,536.34	UBS AG Stamford, CT
BRL	8,694,315.40	USD	(1,720,760.68)	03/08/2021	6,020.23	Goldman Sachs Bank USA
RUB	22,937,085.37	USD	(306,125.77)	20/08/2021	5,673.38	Goldman Sachs Bank USA
USD	168,106.41	EUR	(137,000.00)	17/08/2021	5,482.07	Bank of America
USD	218,136.03	GBP	(155,000.00)	17/08/2021	3,987.31	MS (FX OPS) London
USD	1,225,397.82	EUR	(1,029,000.00)	17/08/2021	3,934.70	JPMorgan Bank, N.A. New York
USD	143,768.57	EUR	(118,000.00)	17/08/2021	3,697.97	Bank of America
USD	101,000.00	PEN	(372,993.00)	04/08/2021	3,392.73	BNP Paribas S.A.
USD	108,621.94	EUR	(89,000.00)	17/08/2021	2,975.47	MS (FX OPS) London
USD	74,000.00	PEN	(274,614.00)	09/12/2021	2,177.31	Standard Chartered Bank London
RUB	3,447,824.00	USD	(44,973.15)	22/07/2021	2,093.71	UBS AG Stamford, CT
USD	1,025,734.75	ZAR	(15,086,000.00)	25/02/2022	2,072.92	Bank of America
USD	558,780.99	MXN	(11,280,000.00)	08/11/2021	1,940.16	BNP Paribas S.A.
RUB	3,198,812.00	USD	(41,754.50)	22/07/2021	1,913.05	Morgan Stanley & Co.
USD	279,069.29	EUR	(234,000.00)	17/08/2021	1,302.17	Bank of America
RUB	4,258,915.00	USD	(56,640.38)	20/08/2021	1,253.90	Bank of America
USD	363,043.16	EUR	(304,905.08)	30/07/2021	1,241.40	JPMorgan Chase & Co.
USD	2,796,148.68	JPY	(310,000,000)	27/09/2021	934.17	Barclays London
USD	67,016.42	MXN	(1,324,000.00)	14/07/2021	618.61	Goldman Sachs Bank USA
USD	74,130.19	EUR	(62,193.36)	30/07/2021	331.27	JPMorgan Chase & Co.
USD	77,426.17	EUR	(64,999.77)	30/07/2021	297.15	JPMorgan Chase & Co.
USD	16,615.59	EUR	(13,922.61)	30/07/2021	94.96	JPMorgan Chase & Co.
USD	3,249.37	EUR	(2,722.92)	30/07/2021	18.34	JPMorgan Chase & Co.
USD	2,990.85	EUR	(2,510.84)	30/07/2021	11.48	JPMorgan Chase & Co.
USD	478.27	EUR	(401.68)	30/07/2021	1.63	JPMorgan Chase & Co.

Razem 1,496,180.55

	Kupiona ilość		Sprzedana ilość	Data zapadalności	Niezrealizowana (strata) USD	Dru ga strona kontraktu
USD	4,931,053.31	BRL	(28,000,000.00)	04/01/2022	(502,989.60)	BNP Paribas S.A.
EUR	39,267,721.59	USD	(46,741,350.70)	30/07/2021	(146,093.32)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	32,172,106.41	USD	(38,295,262.56)	30/07/2021	(119,694.49)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	5,165,565.59	USD	(6,148,701.86)	30/07/2021	(19,218.19)	JPMorgan Chase & Co.
USD	430,100.70	PEN	(1,710,553.50)	22/09/2021	(17,711.62)	Standard Chartered Bank London
USD	1,965,003.20	ILS	(6,437,940.00)	31/01/2022	(17,370.52)	Goldman Sachs Bank USA
GBP	443,000.00	USD	(625,668.75)	17/08/2021	(13,617.90)	JPMorgan Bank, N.A. New York
CLP	537,482,000.00	USD	(748,238.27)	08/09/2021	(11,384.31)	Morgan Stanley & Co.
USD	1,389,898.32	ILS	(4,538,435.00)	31/01/2022	(7,578.87)	Goldman Sachs Bank USA
USD	1,726,261.37	BRL	(8,694,315.40)	02/07/2021	(6,416.05)	Goldman Sachs Bank USA
EUR	477,000.00	USD	(570,066.28)	17/08/2021	(3,848.68)	JPMorgan Bank, N.A. New York
USD	45,300.09	MXN	(936,000.00)	14/07/2021	(1,639.75)	Standard Chartered Bank
ZAR	3,077,000.00	USD	(214,625.86)	15/09/2021	(1,232.15)	MS (FX OPS) London
EUR	150,000.18	USD	(179,013.96)	30/07/2021	(1,023.06)	JPMorgan Chase & Co.
RUB	5,964,866.00	USD	(81,733.33)	20/09/2021	(1,008.54)	Bank of America

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

USD	243,000.00	BRL	(1,223,748.00)	02/07/2021	(878.95)	BNP Paribas S.A.
USD	670,393.38	PEN	(2,563,785.40)	03/09/2021	(873.24)	BNP Paribas S.A.
RUB	8,737,172.00	USD	(119,078.03)	20/09/2021	(834.57)	Goldman Sachs Bank USA
EUR	110,120.01	USD	(131,419.97)	30/07/2021	(751.06)	JPMorgan Chase & Co.
RUB	4,088,483.00	USD	(56,053.23)	20/09/2021	(722.24)	Bank of America
EUR	68,610.88	USD	(82,049.14)	30/07/2021	(635.16)	JPMorgan Chase & Co.
RUB	4,149,355.00	USD	(56,715.66)	20/09/2021	(560.87)	Goldman Sachs Bank USA
RUB	4,257,053.00	USD	(58,032.61)	20/09/2021	(420.30)	UBS AG Stamford, CT
EUR	39,999.88	USD	(47,677.10)	30/07/2021	(213.06)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	30,000.01	USD	(35,800.27)	30/07/2021	(202.12)	JPMorgan Chase & Co.
Razem					(876,918.62)	

Na dzień 30 czerwca 2021 roku, Subfundusz SANTANDER FUTURE WEALTH miał zawarte następujące terminowe kontrakty walutowe:

	Kupiona ilość		Sprzedana ilość	Data zapadalności	Niezrealizowana (strata) USD	Druga strona kontraktu
BRL	3,877,781.60	USD	(784,000.00)	30/07/2021	(13,459.88)	JPMorgan Chase & Co.
BRL	3,110,728.92	USD	(628,000.00)	30/07/2021	(9,878.17)	JPMorgan Chase & Co.
BRL	2,595,999.41	USD	(523,000.00)	30/07/2021	(7,158.24)	JPMorgan Chase & Co.
BRL	25,944,986.50	USD	(5,158,972.08)	30/07/2021	(3,536.54)	JPMorgan Chase & Co.
BRL	473,517.05	USD	(95,000.00)	30/07/2021	(909.12)	JPMorgan Chase & Co.
BRL	4,156,498.08	USD	(826,000.00)	30/07/2021	(77.12)	JPMorgan Chase & Co.
Razem					(35,019.07)	

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2021 roku

Nota 11 - Kontrakty futures (c.d.)

Na dzień 31 czerwca 2021 roku, Subfundusz SANTANDER AM EURO EQUITY miał zawarte następujące kontrakty futures:

Waluta	Ilość kontraktów kupiona/ (sprzedana)	Opis	Data zapadalności	Wartość rynkowa	Niezrealizowana (strata) USD	Druga strona kontraktu
EUR	120.00	EURO STOXX 50 EQUITY INDEX	17/09/2021	EUR 4,866,600.00	(62,400.00)	Banco Santander S.A.
				Razem	(62,400.00)	

Na dzień 31 czerwca 2021 roku, Subfundusz SANTANDER GO DYNAMIC BOND miał zawarte następujące kontrakty futures:

Waluta	Ilość kontraktów kupiona/ (sprzedana)	Opis	Data zapadalności	Wartość rynkowa	Niezrealizowany zysk USD	Druga strona kontraktu
EUR	51.00	EURO-BTP BOND FUTURE BOND	08/09/2021	EUR 7,721,910.00	99,935.80	Banco Santander S.A.
				Razem	99,935.80	

Waluta	Ilość kontraktów kupiona/ (sprzedana)	Opis	Data zapadalności	Wartość rynkowa	Niezrealizowana (strata) USD	Druga strona kontraktu
USD	(42.00)	US ULTRA BOND CBT BOND	21/09/2021	USD 8,092,875.00	(394,406.25)	Banco Santander S.A.
USD	(130.00)	US 10YR ULTRA BOND	21/09/2021	USD 19,136,406.25	(367,304.28)	Banco Santander S.A.
USD	275.00	US 5YR NOTE (CBT) BOND	30/09/2021	USD 33,943,164.20	(125,773.30)	Banco Santander S.A.
USD	44.00	US 10YR NOTE (CBT) BOND	21/09/2021	USD 5,830,000.00	(10,752.04)	Banco Santander S.A.
GBP	(3.00)	LONG GILT FUTURE BOND	28/09/2021	GBP 384,300.00	(5,180.44)	Banco Santander S.A.
USD	(1.00)	US LONG BOND(CBT) BOND	21/09/2021	USD 160,750.00	(5,078.12)	Banco Santander S.A.
EUR	(3.00)	EURO-BUND FUTURE BOND	08/09/2021	EUR 517,830.00	(3,735.59)	Banco Santander S.A.
				Razem	(912,230.02)	

Na dzień 31 czerwca 2021 roku, Subfundusz SANTANDER FUTURE WEALTH miał zawarte następujące kontrakty futures:

Waluta	Ilość kontraktów kupiona/ (sprzedana)	Opis	Data zapadalności	Wartość rynkowa	Niezrealizowany zysk USD	Druga strona kontraktu
USD	28.00	S&P500 EMINI EQUITY INDEX	17/09/2021	USD 6,003,900.00	70,200.00	Banco Santander S.A.
				Razem	70,200.00	

Nota 12 – Kontrakty na opcje

Na dzień 30 czerwca 2021 roku, Subfundusz SANTANDER GO AKCJI PÓŁNOCNOAMERYKAŃSKICH miał zawarte kontrakty na opcje:

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2021 roku

Waluta	Opis	Kupno/ sprzedaż	Cena wykonania	Data zapadalności	Ilość kupiona	Wartość rynkowa USD	Druga strona kontraktu
USD	FOREIGN EXCHANGE OPTION - FXO	Kupno	7.57	30/03/2022	328,669,497.12	212,536.74	Goldman Sachs International
USD	FOREIGN EXCHANGE OPTION - FXO	Kupno	7.45	06/01/2022	271,799,591.95	71,129.25	BNP Paribas S.A.
USD	FOREIGN EXCHANGE OPTION - FXO	Kupno	7.64	11/11/2021	208,921,622.75	3,304.66	BNP Paribas S.A.
USD	FOREIGN EXCHANGE OPTION - FXO	Kupno	7.99	10/09/2021	132,732,592.50	0.02	BNP Paribas S.A.
USD	FOREIGN EXCHANGE OPTION	Kupno	8.06	23/07/2021	127,462,796.93	0.00	Natwest Markets Plc
Razem						286,970.67	

Na dzień 30 czerwca 2021 roku, Subfundusz SANTANDER GO DYNAMIC BOND miał zawarte następujące kontrakty na opcje:

Waluta	Opis	Kupno/ sprzedaż	Cena wykonania	Data zapadalności	Ilość kupiona	Wartość rynkowa USD	Druga strona kontraktu
USD	SWAPTION - SOP	Kupno	2.28	29/06/2023	1,300,000.00	62,312.12	Bank of America
USD	SWAPTION - SOP	Kupno	1.80	29/09/2021	5,500,000.00	20,156.51	Morgan Stanley Capital Services
USD	BOND OPTION - BOP	Sprzedaż	1.00	05/08/2021	200,000.00	800.32	JPMorgan Chase & Co.
USD	BOND OPTION - BOP	Sprzedaż	1.00	05/08/2021	200,000.00	630.71	JPMorgan Chase & Co.
USD	BOND OPTION - BOP	Sprzedaż	1.00	07/07/2021	1,300,000.00	175.15	JPMorgan Chase & Co.
Razem						84,074.81	

Waluta	Opis	Kupno/ sprzedaż	Cena wykonania	Data zapadalności	Ilość sprzedana	Zaangażowanie	Wartość rynkowa USD	Druga strona kontraktu
USD	SWAPTION - SOP	Put	2.11	29/06/2023	(6,400,000.00)	USD 1,689,600.00	(64,359.04)	Bank of America
USD	CREDIT DEFAULT SWAP INDEX OPTION	Put	0.01	20/10/2021	(6,600,000.00)	USD 6,600,000.00	(4,619.34)	Goldman Sachs International
USD	BOND OPTION - BOP	Call	1.01	07/09/2021	(1,000,000.00)	USD 1,000,000.00	(4,054.50)	JPMorgan Chase & Co.
USD	SWAPTION - SOP	Put	2.30	29/09/2021	(5,500,000.00)	USD 283,564.60	(2,741.27)	Morgan Stanley Capital Services
USD	BOND OPTION - BOP	Put	1.04	07/09/2021	(1,000,000.00)	USD 1,000,000.00	(2,352.69)	JPMorgan Chase & Co.
USD	BOND OPTION - BOP	Put	1.02	05/08/2021	(1,500,000.00)	USD 1,500,000.00	(2,074.69)	JPMorgan Chase & Co.
USD	BOND OPTION - BOP	Put	1.02	05/08/2021	(1,300,000.00)	USD 1,300,000.00	(1,450.76)	JPMorgan Chase & Co.
USD	BOND OPTION - BOP	Put	1.02	12/08/2021	(800,000.00)	USD 800,000.00	(1,305.44)	JPMorgan Chase & Co.
USD	BOND OPTION - BOP	Put	1.04	07/09/2021	(800,000.00)	USD 800,000.00	(1,269.60)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	CREDIT DEFAULT SWAP INDEX OPTION	Put	0.01	20/10/2021	(2,100,000.00)	USD 2,488,741.41	(1,249.68)	Barclays Bank PLC
USD	CREDIT DEFAULT SWAP INDEX OPTION	Put	1.01	20/10/2021	(400,000.00)	USD 400,000.00	(1,143.76)	Bank of America
USD	BOND OPTION - BOP	Call	1.04	05/08/2021	(1,300,000.00)	USD 1,300,000.00	(987.13)	JPMorgan Chase & Co.
USD	CREDIT DEFAULT SWAP INDEX OPTION	Put	0.01	20/10/2021	(1,300,000.00)	USD 1,300,000.00	(794.43)	Goldman Sachs International
USD	BOND OPTION - BOP	Put	0.99	05/08/2021	(400,000.00)	USD 400,000.00	(775.61)	JPMorgan Chase & Co.
USD	CREDIT DEFAULT SWAP INDEX OPTION	Put	0.01	20/10/2021	(1,100,000.00)	USD 1,100,000.00	(769.89)	JP Morgan Securities Plc
EUR	CREDIT DEFAULT SWAP INDEX OPTION	Call	0.004	21/07/2021	(1,200,000.00)	USD 1,422,137.95	(707.70)	Barclays Bank PLC

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2021 roku

Waluta	Opis	Typ	Ilość	Data	Wartość	Wartość	Strona
USD	BOND OPTION - BOP	Put	1.04	05/08/2021	(400,000.00)	USD 400,000.00	(650.68) JPMorgan Chase & Co.
USD	BOND OPTION - BOP	Put	0.99	05/08/2021	(400,000.00)	USD 400,000.00	(628.47) JPMorgan Chase & Co.
USD	CREDIT DEFAULT SWAP INDEX OPTION	Call	0.005	18/08/2021	(500,000.00)	USD 500,000.00	(358.40) Barclays Bank PLC
USD	CREDIT DEFAULT SWAP INDEX OPTION	Put	0.01	15/09/2021	(500,000.00)	USD 500,000.00	(173.70) Barclays Bank PLC
EUR	CREDIT DEFAULT SWAP INDEX OPTION	Put	0.01	18/08/2021	(1,000,000.00)	USD 1,185,114.96	(148.71) BNP Paribas London Br
EUR	CREDIT DEFAULT SWAP INDEX OPTION	Put	0.01	18/08/2021	(700,000.00)	USD 829,580.47	(114.56) Barclays Bank PLC
EUR	CREDIT DEFAULT SWAP INDEX OPTION	Put	0.01	18/08/2021	(600,000.00)	USD 711,068.97	(81.04) Barclays Bank PLC
USD	BOND OPTION - BOP	Call	1.04	07/07/2021	(800,000.00)	USD 800,000.00	(55.52) JPMorgan Chase & Co.
USD	CREDIT DEFAULT SWAP INDEX OPTION	Put	0.01	18/08/2021	(400,000.00)	USD 400,000.00	(44.72) Goldman Sachs International
EUR	CREDIT DEFAULT SWAP INDEX OPTION	Put	0.01	21/07/2021	(800,000.00)	USD 948,091.96	(33.11) Bank of America
EUR	CREDIT DEFAULT SWAP INDEX OPTION	Put	0.75	21/07/2021	(700,000.00)	USD 829,580.47	(28.97) Goldman Sachs International
EUR	CREDIT DEFAULT SWAP INDEX OPTION	Put	0.75	21/07/2021	(700,000.00)	USD 829,580.47	(28.97) Barclays Bank PLC
USD	BOND OPTION - BOP	Put	1.02	07/07/2021	(800,000.00)	USD 800,000.00	(26.12) JPMorgan Chase & Co.
USD	CREDIT DEFAULT SWAP INDEX OPTION	Put	0.01	21/07/2021	(300,000.00)	USD 300,000.00	(5.25) Goldman Sachs International
EUR	CREDIT DEFAULT SWAP INDEX OPTION	Put	0.01	21/07/2021	(1,200,000.00)	USD 1,422,137.95	(3.56) Barclays Bank PLC
USD	CREDIT DEFAULT SWAP INDEX OPTION	Put	0.01	21/07/2021	(600,000.00)	USD 600,000.00	(3.24) JP Morgan Securities Plc
EUR	CREDIT DEFAULT SWAP INDEX OPTION	Put	0.01	21/07/2021	(600,000.00)	USD 711,068.97	(1.78) Goldman Sachs International
USD	SWAPTION - SOP	Put	1.76	07/07/2021	(100,000.00)	USD 2,439.99	(0.73) Morgan Stanley Capital Services
						Razem	(93,043.06)

Na dzień 30 czerwca 2021 roku, Subfundusz SANTANDER FUTURE WEALTH miał zawarte następujące kontrakty na opcje:

Waluta	Opis	Kupno/sprzedaż	Cena wykonania	Data zapadalności	Ilość kupiona	Zaangażowanie	Wartość rynkowa USD	Druga strona kontraktu
USD	E-MINI NASDAQ 100	Kupno	13,200.00	17/09/2021	43.00		150,070.00	Banco Santander S.A.
						Razem	150,070.00	

Waluta	Opis	Kupno/sprzedaż	Cena wykonania	Data zapadalności	Ilość sprzedana	Zaangażowanie	Wartość rynkowa USD	Druga strona kontraktu
USD	E-MINI NASDAQ 100	Sprzedaż	14,200.00	17/09/2021	(43.00)	USD 12,212,000.00	(629,735.00)	Banco Santander S.A.
						Razem	(629,735.00)	

Nota 13 – Kontrakty swap ryzyka kredytowego

Na dzień 30 czerwca 2021 roku, Subfundusz SANTANDER GO DYNAMIC BOND miał zawarte następujące kontrakty swap ryzyka kredytowego:

Ilość	Waluta	Jednostka ref.	Kupno/Sprzedaż	Odsetki (Zapłacone) Otrzymane	Data zapadalności	Wartość rynkowa USD	Niezrealizowany zysk/(strata) USD	Druga strona kontraktu
600,000	USD	CDS	Sell	5.000%	12/20/2025	110,330.45	110,330.45	Morgan Stanley & Co. Incorporated
400,000	EUR	CDS	Sell	5.000%	06/20/2026	93,393.94	93,393.94	Morgan Stanley & Co. Incorporated
300,000	EUR	CDS	Sell	5.000%	12/20/2025	65,022.80	65,022.80	JPMorgan Chase & Co.
300,000	USD	CDS	Sell	5.000%	12/20/2025	57,509.37	57,509.37	Morgan Stanley & Co. Incorporated
200,000	USD	CDS	Sell	5.000%	12/20/2025	38,339.58	38,339.58	Morgan Stanley & Co. Incorporated

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2021 roku

1,500,000	USD	CDI	Sell	1.000%	12/20/2025	38,314.02	38,314.02	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,200,000	USD	CDI	Sell	1.000%	06/20/2026	30,869.73	30,869.73	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,200,000	USD	CDI	Sell	1.000%	06/20/2026	30,869.73	30,869.73	Morgan Stanley & Co. Incorporated
100,000	USD	CDS	Sell	5.000%	12/20/2025	19,169.79	19,169.79	Morgan Stanley & Co. Incorporated
500,000	EUR	CDI	Sell	1.000%	12/20/2025	16,389.48	16,389.48	Morgan Stanley & Co. Incorporated
600,000	USD	CDI	Sell	1.000%	06/20/2026	15,434.87	15,434.87	Morgan Stanley & Co. Incorporated
600,000	USD	CDI	Sell	1.000%	06/20/2026	15,434.87	15,434.87	Morgan Stanley & Co. Incorporated
600,000	USD	CDI	Sell	1.000%	06/20/2026	15,434.87	15,434.87	Morgan Stanley & Co. Incorporated
600,000	USD	CDI	Sell	1.000%	06/20/2026	15,434.87	15,434.87	Morgan Stanley & Co. Incorporated
600,000	USD	CDI	Sell	1.000%	06/20/2026	15,434.87	15,434.87	Morgan Stanley & Co. Incorporated
100,000	USD	CDI	Sell	5.000%	06/20/2026	10,338.89	10,338.89	Morgan Stanley & Co. Incorporated
400,000	USD	CDI	Sell	1.000%	06/20/2026	10,289.91	10,289.91	Morgan Stanley & Co. Incorporated
400,000	USD	CDI	Sell	1.000%	06/20/2026	10,289.91	10,289.91	Morgan Stanley & Co. Incorporated
300,000	USD	CDI	Sell	1.000%	06/20/2026	7,717.43	7,717.43	Morgan Stanley & Co. Incorporated
300,000	USD	CDI	Sell	1.000%	06/20/2026	7,717.43	7,717.43	Morgan Stanley & Co. Incorporated
300,000	USD	CDI	Sell	1.000%	06/20/2026	7,717.43	7,717.43	Morgan Stanley & Co. Incorporated
300,000	USD	CDI	Sell	1.000%	06/20/2026	7,717.43	7,717.43	Morgan Stanley & Co. Incorporated
300,000	USD	CDI	Sell	1.000%	06/20/2026	7,717.43	7,717.43	Morgan Stanley & Co. Incorporated
300,000	USD	CDI	Sell	1.000%	06/20/2026	7,717.43	7,717.43	Morgan Stanley & Co. Incorporated
300,000	USD	CDS	Sell	1.000%	06/20/2026	5,561.81	5,561.81	Morgan Stanley & Co. Incorporated
200,000	USD	CDI	Sell	1.000%	06/20/2026	5,144.96	5,144.96	Morgan Stanley & Co. Incorporated
200,000	USD	CDI	Sell	1.000%	06/20/2026	5,144.96	5,144.96	Morgan Stanley & Co. Incorporated
200,000	USD	CDS	Sell	1.000%	06/20/2026	3,707.88	3,707.88	Morgan Stanley & Co. Incorporated
300,000	EUR	CDS	Sell	1.000%	06/20/2028	3,243.61	3,243.61	Morgan Stanley & Co. Incorporated
400,000	USD	CDS	Sell	1.000%	12/20/2025	3,199.23	3,199.23	Bank of America
100,000	USD	CDS	Sell	1.000%	12/20/2024	2,337.35	2,337.35	Morgan Stanley & Co. Incorporated
100,000	USD	CDS	Sell	1.000%	12/20/2024	2,337.23	2,337.23	Morgan Stanley & Co. Incorporated
300,000	EUR	CDS	Sell	1.000%	06/20/2028	2,253.97	2,253.97	Morgan Stanley & Co. Incorporated
200,000	EUR	CDS	Sell	1.000%	06/20/2028	2,162.42	2,162.42	Morgan Stanley & Co. Incorporated
200,000	EUR	CDS	Sell	1.000%	06/20/2028	1,502.65	1,502.65	Morgan Stanley & Co. Incorporated
100,000	EUR	CDS	Sell	1.000%	06/20/2028	1,081.21	1,081.21	Morgan Stanley & Co. Incorporated
100,000	EUR	CDS	Sell	1.000%	06/20/2028	751.33	751.33	Morgan Stanley & Co. Incorporated
200,000	USD	CDS	Sell	1.000%	12/20/2024	(16.42)	(16.42)	Bank of America
100,000	USD	CDS	Sell	1.000%	12/20/2024	(642.70)	(642.70)	BNP Paribas S.A.
200,000	USD	CDS	Sell	1.000%	12/20/2025	(2,125.26)	(2,125.26)	Bank of America
200,000	USD	CDS	Sell	1.000%	12/20/2024	(2,394.54)	(2,394.54)	Barclays Bank PLC
200,000	USD	CDS	Sell	1.000%	12/20/2025	(5,854.84)	(5,854.84)	Goldman Sachs Bank USA
300,000	USD	CDS	Sell	1.000%	12/20/2025	(6,286.90)	(6,286.90)	BNP Paribas S.A.
300,000	USD	CDI	Sell	1.000%	06/20/2026	(7,714.03)	(7,714.03)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
500,000	USD	CDI	Sell	1.000%	06/20/2026	(12,856.71)	(12,856.71)	Morgan Stanley & Co. Incorporated

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2021 roku

600,000	USD	CDI	Sell	1.000%	12/20/2025	(20,775.61)	(20,775.61)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
600,000	USD	CDI	Sell	1.000%	12/20/2025	(20,775.61)	(20,775.61)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,000,000	USD	CDI	Sell	1.000%	06/20/2026	(25,713.42)	(25,713.42)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,200,000	USD	CDI	Sell	1.000%	12/20/2025	(41,551.23)	(41,551.23)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
Razem						538,610.44	538,610.44	

Nota 14 – Kontrakty swap stóp procentowych

Na dzień 31 czerwca 2021 roku, Subfundusz SANTANDER GO DYNAMIC BOND miał zawarte następujące kontrakty swap stóp procentowych:

Ilość	Data Waluta zapadalności	Opis	Stopa procentowa otrzymana	Stopa procentowa zapłacona	Niezrealizowany zysk/(strata) EUR	Druga strona kontraktu
1,000,000	USD 03/30/2021	IRS	LIBOR 3M	1.150%	141,326.27	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,190,000	USD 06/16/2021	IRS	LIBOR 3M	1.250%	135,552.28	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,280,000	USD 03/30/2021	IRS	LIBOR 3M	0.750%	74,872.33	Morgan Stanley & Co. Incorporated
66,923,235	BRL 01/03/2022	OIS	CDI 1D	3.360%	56,958.86	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,800,000	GBP 09/15/2021	OIS	SONIA 1D	0.750%	49,957.80	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,200,000	GBP 09/15/2021	OIS	SONIA 1D	0.750%	33,305.20	Morgan Stanley & Co. Incorporated
20,688,031	BRL 01/02/2024	OIS	7.790%	CDI 1D	26,033.77	Morgan Stanley & Co. Incorporated
33,293,367	BRL 01/02/2023	OIS	7.115%	CDI 1D	21,425.66	Morgan Stanley & Co. Incorporated
4,700,000	GBP 09/15/2021	OIS	0.750%	SONIA 1D	15,058.29	Morgan Stanley & Co. Incorporated
15,000,000	CNY 06/16/2026	NDIRS	2.900%	CFXS 1W	13,660.32	Morgan Stanley & Co. Incorporated
100,000	USD 06/16/2021	IRS	LIBOR 3M	1.250%	11,390.95	Morgan Stanley & Co. Incorporated
3,497,966	BRL 01/03/2022	OIS	CDI 1D	2.859%	8,538.97	Morgan Stanley & Co. Incorporated
2,527,671	BRL 01/03/2022	OIS	CDI 1D	2.850%	6,289.92	Morgan Stanley & Co. Incorporated
100,000	USD 03/30/2021	IRS	LIBOR 3M	0.750%	5,667.91	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,847,145	BRL 01/03/2022	OIS	CDI 1D	2.850%	4,596.48	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,555,686	BRL 01/03/2022	OIS	CDI 1D	2.860%	3,863.43	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,554,830	BRL 01/03/2022	OIS	CDI 1D	2.871%	3,784.15	Morgan Stanley & Co. Incorporated
874,193	BRL 01/03/2022	OIS	CDI 1D	2.883%	2,087.51	Morgan Stanley & Co. Incorporated
680,318	BRL 01/03/2022	OIS	CDI 1D	2.870%	1,661.41	Morgan Stanley & Co. Incorporated
200,000	CAD 06/17/2022	IRS	0.500%	BA 3M	1,594.15	Morgan Stanley & Co. Incorporated
200,000	CAD 03/03/2022	IRS	0.270%	BA 3M	1,311.90	Morgan Stanley & Co. Incorporated
200,000	CAD 03/03/2022	IRS	0.270%	BA 3M	1,311.90	Morgan Stanley & Co. Incorporated
388,753	BRL 01/03/2022	OIS	CDI 1D	2.870%	949.38	Morgan Stanley & Co. Incorporated
4,700,000	CNY 03/17/2026	NDIRS	2.790%	CFXS 1W	895.29	Morgan Stanley & Co. Incorporated
100,000	CAD 03/03/2022	IRS	0.273%	BA 3M	657.97	Morgan Stanley & Co. Incorporated
100,000	CAD 03/03/2025	IRS	0.276%	BA 3M	319.71	Morgan Stanley & Co. Incorporated
100,000	CAD 03/03/2025	IRS	0.275%	BA 3M	316.54	Morgan Stanley & Co. Incorporated
6,000,000	CNY 12/16/2025	NDIRS	2.755%	CFXS 1W	210.99	Morgan Stanley & Co. Incorporated
100,000	CAD 03/04/2025	IRS	1.235%	BA 3M	186.46	Morgan Stanley & Co. Incorporated
100,000	CAD 03/04/2025	IRS	1.235%	BA 3M	186.46	Morgan Stanley & Co. Incorporated
100,000	CAD 03/04/2025	IRS	2.235%	BA 3M	186.46	Morgan Stanley & Co. Incorporated
100,000	CAD 03/03/2025	IRS	1.220%	BA 3M	142.06	Morgan Stanley & Co. Incorporated
3,200,000	CNY 12/16/2025	NDIRS	2.755%	CFXS 1W	112.53	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,200,000	CNY 12/16/2025	NDIRS	2.755%	CFXS 1W	42.20	Morgan Stanley & Co. Incorporated
2,200,000	GBP 09/15/2026	OIS	SONIA 1D	0.500%	(762.20)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,065,124	BRL 01/03/2022	OIS	4.040%	CDI 1D	(1,026.16)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
800,000	USD 03/17/2025	IRS	0.6125%	LIBOR 3M	(1,820.14)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
2,421,546	BRL 01/03/2022	OIS	3.978%	CDI 1D	(2,531.55)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
2,132,589	BRL 01/03/2022	OIS	3.350%	CDI 1D	(3,584.02)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
2,617,968	BRL 01/03/2022	OIS	3.700%	CDI 1D	(3,592.93)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
2,229,918	BRL 01/03/2022	OIS	3.345%	CDI 1D	(3,792.66)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
2,200,000	USD 03/20/2025	IRS	0.622%	LIBOR 3M	(4,517.64)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
6,100,000	CNY 03/17/2026	NDIRS	2.655%	CFXS 1W	(4,531.59)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
2,811,140	BRL 01/03/2022	OIS	3.350%	CDI 1D	(4,724.39)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
4,266,318	BRL 01/03/2022	OIS	3.700%	CDI 1D	(5,855.15)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
5,234,537	BRL 01/03/2022	OIS	3.350%	CDI 1D	(8,797.14)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
6,397,768	BRL 01/03/2022	OIS	3.350%	CDI 1D	(10,752.06)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
300,000	GBP 11/15/2034	RPI	3.345%	UKRPI 1M	(11,127.47)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
12,706,918	BRL 01/03/2022	OIS	3.364%	CDI 1D	(13,593.76)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
10,178,267	BRL 01/03/2022	OIS	3.350%	CDI 1D	(17,105.55)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
8,436,100	BRL 01/03/2022	OIS	2.973%	CDI 1D	(18,153.35)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,200,000	CAD 06/16/2026	IRS	1.000%	BA 3M	(20,558.69)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,200,000	CAD 06/16/2026	IRS	1.000%	BA 3M	(20,558.69)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
13,183,279	BRL 01/03/2022	OIS	3.350%	CDI 1D	(22,155.76)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
14,831,189	BRL 01/03/2022	OIS	3.350%	CDI 1D	(24,925.22)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,700,000	CAD 06/16/2026	IRS	1.000%	BA 3M	(29,124.81)	Morgan Stanley & Co. Incorporated

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2021 roku

3,500,000	USD	02/18/2026	IRS	0.640%	LIBOR 3M	(30,053.90)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
2,000,000	CAD	06/16/2026	IRS	1.000%	BA 3M	(34,264.48)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
2,100,000	CAD	06/16/2026	IRS	1.000%	BA 3M	(35,977.70)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
2,200,000	CAD	06/16/2026	IRS	1.000%	BA 3M	(37,690.92)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
100,000,000	MXN	03/24/2023	IRS	5.660%	TIE 4W	(46,002.98)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
150,000,000	MXN	03/24/2023	IRS	5.660%	TIE 4W	(69,004.47)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,300,000	USD	12/15/2051	IRS	LIBOR 3M	2.000%	(80,166.58)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
2,200,000	USD	12/15/2051	IRS	LIBOR 3M	2.000%	(135,666.52)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
8,100,000	USD	06/16/2026	IRS	0.500%	LIBOR 3M	(167,135.58)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
					Razem	(245,098.55)	

Nota 16 - Umowy z przyrzeczeniem odkupu

Na dzień 30 czerwca 2021 roku, Subfundusz SANTANDER GO DYNAMIC BOND miał zawarte następujące umowy z przyrzeczeniem odkupu, których wartość wykazano poniżej, w walucie Subfunduszu, na mocy których udzielono instytucjom finansowym pożyczek na określoną kwotę, gwarantowanych zabezpieczeniem. Na dzień 30 czerwca 2021 r. pożyczki udzielone zgodnie z tymi umowami były gwarantowane następującymi aktywami bazowymi:

Waluta	Ilość	Opis	Druga strona kontraktu	Wartość w USD (Koszt)	Wartość w USD (Wartość rynkowa)
USD	50,209,000.00	UNITED STATES OF AMERICA BOND FIXED 2.500% 31/03/2023	BOFA Securities, Inc.(USA)	51,500,000.00	52,535,300.00
USD	51,690,000.00	UNITED STATES OF AMERICA BOND FIXED 1.375% 15/11/2040	BOFA Securities, Inc.(USA)	45,671,000.00	46,278,703.13
USD	9,533,000.00	UNITED STATES OF AMERICA BOND FIXED 1.875% 15/02/2041	BOFA Securities, Inc.(USA)	9,229,000.00	9,303,612.19
USD	3,030,800.00	UNITED STATES OF AMERICA BOND FIXED 2.750% 15/02/2028	BNP Paribas (FR)	3,300,000.00	3,373,598.00
			Razem	109,700,000.00	111,491,213.31

Nota 17 - Istotne zdarzenia

Od końca roku obserwujemy rozwój epidemii koronawirusa Covid-19 początkowo w Chinach, a teraz po dotarciu do większości kontynentów. Obecnie nie jest możliwa szczegółowa ocena wpływu tego ryzyka na spółki w naszym portfelu, ale rosną obawy o wpływ tego czynnika na gospodarkę światową. Odbyła się znacząca korekta na rynkach finansowych w ostatnich tygodniach. Zarząd i Zarządzający Funduszami nadal obserwują wysiłki rządów zmierzające do powstrzymania rozprzestrzeniania się wirusa i monitorowania ewentualnego wpływu gospodarczego na spółki w naszym portfelu.

Nota 18 - Wydarzenia po zakończeniu okresu sprawozdawczego

Brak istotnych zdarzeń.

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Inne informacje

Rozporządzenie w sprawie przejrzystości transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i ponownego wykorzystania ("Rozporządzenie SFTR")

Na dzień 30 czerwca 2021 roku, Subfundusz SICAV spełnia wymagania Rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2015/2365 z dnia 25 listopada 2015 r. w sprawie przejrzystości transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i ponownego wykorzystania. Na dzień 30 czerwca 2021 r. przepisom niniejszego Rozporządzenia podlegały umowy z przyrzeczeniem odkupu oraz swapy na akcje.

SANTANDER GO DYNAMIC BOND

	USD
Kwota umów z udzielonym przyrzeczeniem odkupu wyrażona w wartościach bezwzględnych	109,700,000.00
Udział w wartości zarządzanych aktywów	37.99%
Termin zapadalności umów z przyrzeczeniem odkupu w rozbiciu na następujące przedziały czasowe (wartości bezwzględne)	
Poniżej jednego dnia	-
Jeden dzień do jednego tygodnia	109,700,000.00
Jeden tydzień do jednego miesiąca	-
Jeden do trzech miesięcy	-
Trzy miesiące do roku	-
Powyżej jednego roku	-
Termin otwarty	-
Razem	109,700,000.00
Druga strona umowy	
Nazwa drugiej strony kontraktu	Zobacz notę 16
Kraj domicyliu drugiej strony umowy	Zobacz notę 16
Wolumen nierozliczonych transakcji brutto	109,700,000.00
Informacje o zabezpieczeniu	
Rodzaj zabezpieczenia:	
Srodki pieniężne	-
Papiery wartościowe	111,491,213.31
Jakość zabezpieczenia:	
Rating	AAA
Data zapadalności zabezpieczenia w rozbiciu na następujące przedziały czasowe	
Poniżej jednego dnia	-
Jeden dzień do jednego tygodnia	-
Jeden tydzień do jednego miesiąca	-
Jeden do trzech miesięcy	-
Trzy miesiące do roku	-
Powyżej jednego roku	111,491,213.31
Termin otwarty	-
Razem	111,491,213.31
Przechowywanie zabezpieczeń otrzymanego przez fundusz w ramach umów z przyrzeczeniem odkupu	
Nazwa depozytariusza	J.P. MORGAN BANK
Srodki pieniężne	LUXEMBOURG S.A.
Papiery wartościowe	-
	111,491,213.31

Wszystkie transakcje są transakcjami dwustronnymi.

Zabezpieczenie umów z przyrzeczeniem odkupu nie jest ponownie wykorzystywane.