

# **SANTANDER SICAV**

**Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym**

*(Société d'Investissement à Capital Variable)*

## **Nierewidowany raport półroczny za okres od 1 stycznia 2022 do 30 czerwca 2022 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 2022 roku

Zestawienie aktywów netto na dzień 30 czerwca 2022 roku

Skonsolidowane zestawienie operacji i zmian w aktywach netto funduszu za okres kończący się 30 czerwca 2022 roku

Zestawienie operacji i zmian w aktywach netto funduszu za okres kończący się 30 czerwca 2022 roku

Dane statystyczne

SANTANDER GO KRÓTKOTERMINOWYCH PAPIERÓW WARTOŚCIOWYCH USD

SANTANDER OBLIGACJI KORPORACYJNYCH AMERYKI ŁACIŃSKIEJ

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 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

SANTANDER GO GLOBALNYCH OBLIGACJI HIGH YIELD

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2022 roku

Inne informacje

---

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

---

## Dyrektorzy i administracja (c.d.)

### 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  
Wielkie Księstwo Luksemburga

#### Dyrektorzy

Pan Luis CAVERO (do 26 stycznia 2022 roku)  
Dyrektor Generalny  
Wielkie Księstwo Luksemburga

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 SE, ODDZIAŁ LUKSEMBURSKI<sup>1</sup>  
6, route de Trèves  
L-2633 Senningerberg,  
Wielkie Księstwo  
Luksemburga

#### Spółka Zarządzająca (znowelizowana Ustawa z 17 grudnia 2010 roku, Rozdział 15)

SANTANDER ASSET MANAGEMENT  
LUXEMBOURG S.A.<sup>2</sup>  
43, Avenue John F. Kennedy  
L-1855 Luksemburg  
Wielkie Księstwo Luksemburga

#### Podmioty Zarządzające Aktywami

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

Dla następujących subfunduszy:

- SANTANDER AKTYWNEGO PORTFELA 1

---

<sup>1</sup> J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. połączył się z J.P. Morgan AG, który w tym samym dniu zmienił nazwę na J.P. Morgan SE, Oddział w Luksemburgu w dniu 22 stycznia 2022 roku.

<sup>2</sup> Z dniem 1 czerwca 2022 zmieniono adres z 19, rue de Bitbourg, L-1273 Luksemburg, Wielkie Księstwo Luksemburga na 43, Avenue John F.Kennedy, L-1855 Luksemburg, Wielkie Księstwo Luksemburga.

---

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

---

## Dyrektorzy i administracja (c.d.)

- SANTANDER AKTYWNEGO PORTFELA 2
- SANTANDER AM AKCJI EUROPEJSKICH
- SANTANDER KUPONU OBLIGACJI KORPORACYJNYCH
- SANTANDER EUROPEJSKICH SPÓŁEK DYWIDENDOWYCH
- SANTANDER AM EUROPEJSKICH OBLIGACJI KORPORACYJNYCH
- SANTANDER AM OBLIGACJI AMERYKI ŁACIŃSKIEJ
- SANTANDER COVERED BOND
- SANTANDER FUTURE WEALTH
- SANTANDER SELECT INCOME
- SANTANDER SELECT DEFENSIVE
- SANTANDER SELECT MODERATE
- SANTANDER SELECT DYNAMIC
- SANTANDER AM SZANS INWESTYCYJNYCH AKCJI EUROPEJSKICH (do 17 czerwca 2022 roku)

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 (do 16 czerwca 2022 roku)
- SANTANDER MULTI INDEX BALANCE
- SANTANDER MULTI INDEX SUBSTANCE
- SANTANDER MULTI INDEX AMBITION
- 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

BLUEBAY ASSET MANAGEMENT LLP  
Grosvenor Street  
Londyn, W1K 3JR  
Wielka Brytania

Dla subfunduszu:

- SANTANDER GO GLOBAL HIGH YIELD BOND

ROBECO INSTITUTIONAL ASSET MANAGEMENT B.V.  
Weena 850  
3014 DA Rotterdam  
Holandia

Dla subfunduszu:

- SANTANDER GO GLOBALNYCH AKCJI ESG
-

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

---

## Dyrektorzy i administracja (c.d.)

JPMORGAN ASSET MANAGEMENT (UK) LIMITED  
25 BankStreet, Canary Wharf  
E14 5JP Londyn  
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  
80335 Monachium  
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.  
7, Calle de los Padres Dominicos  
E-28050 Madryt  
Hiszpania

## Audytor

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

## Doradca prawny

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

---

# 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 kończy 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 domicylem 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 2022 roku

	Noty	EUR
<b>AKTYWA</b>		
Inwestycje w papiery wartościowe po cenie rynkowej	3.1	4,803,291,602.88
Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 14	4,013,802.08
Opcje kupione po cenie rynkowej	3.6, 13	27,961,345.49
Swapy total return po cenie rynkowej	3.13, 16	2,579,592.65
Środki pieniężne w banku	3.1	213,409,189.51
Środki pieniężne u brokera	3.1	74,823,980.32
Należności z tytułu sprzedaży papierów wartościowych		108,730,165.68
Należności z subskrypcji		2,755,003.24
Należne odsetki i dywidendy netto	3.11	15,178,852.26
Rozliczenia międzyokresowe kosztów	3.12	194,396.57
Niezrealizowany zysk netto z kontraktów term. forward	3.4, 11	8,006,902.87
Niezrealizowany zysk z kontraktów futures	3.5, 12	6,735,508.68
Niezrealizowany zysk z kontraktów swap stóp proc.	3.7, 15	22,404,900.40
Inne należności		4,191,735.67
<b>Aktywa ogółem</b>		<b>5,294,276,978.30</b>
<b>PASYWA</b>		
Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 14	1,959,876.73
Wartość rynkowa opcji	3.6, 13	21,835,667.80
Swapy total return po cenie rynkowej	3.9, 16	390,541.90
Kredyt w rachunku bankowym	3.1	217,240.37
Kredyt w rachunku brokera	3.1	27,378,441.18
Zobowiązania z tytułu odsetek i dywidend netto	3.11	559,083.61
Zobowiązania z tytułu nabycia papierów wartościowych		13,382,360.97
Zobowiązania z tytułu umorzeń		54,215,669.09
Zobowiązania z tytułu podatków i inne koszty	6	6,942,487.93
Niezrealizowana strata z kontraktów walutowych	3.4, 11	8,774,617.15
Niezrealizowana strata z kontraktów futures	3.5, 12	10,758,566.50
Niezrealizowana strata z kontraktów swap stóp proc.	3.7, 15	23,072,322.76
Inne wymagane płatności		735,737.42
<b>Pasywa ogółem</b>		<b>170,222,613.41</b>
<b>Aktywa netto razem</b>		<b>5,124,054,364.89</b>

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

---

## Zestawienie aktywów netto na dzień 30 czerwca 2022 roku (c.d.)

SANTANDER GO  
AKCJI PÓŁNOCNO  
AMERYKAŃSKICH

USD

Noty

### AKTYWA

Inwestycje w papiery wartościowe po cenie rynkowej	3.1	651,165,983.09
Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 14	-
Opcje kupione po cenie rynkowej	3.6, 13	430,107.94
Swapy total return po cenie rynkowej	3.9, 16	-
Środki pieniężne w banku	3.1	3,666,345.40
Środki pieniężne u brokera	3.1	-
Należności z tytułu sprzedaży papierów wartościowych		-
Należności z subskrypcji		237,549.44
Należności z tytułu odsetek i dywidend netto	3.11	-
Rozliczenia międzyokresowe kosztów	3.12	27,995.94
Niezrealizowany zysk netto z kontraktów term. forward	3.4, 11	44,922.78
Niezrealizowany zysk z kontraktów futures	3.5, 12	-
Niezrealizowany zysk z kontraktów swap stóp procentowych	3.7, 15	-
Inne należności		34,281.98

### Aktywa ogółem

**655,607,186.57**

### PASYWA

Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 14	-	-
Wartość rynkowa opcji	3.6, 13	-	-
Swapy total return po cenie rynkowej	3.9, 16	-	-
Kredyt w rachunku bankowym	3.1	-	-
Kredyt w rachunku brokera	3.1	0.28	-
Zobowiązania z tytułu odsetek i dywidend netto	3.11	-	-
Zobowiązania z tytułu nabycia pap. wartościowych		-	-
Zobowiązania z tytułu umorzeń		996,168.91	-
Zobowiązania z tytułu podatków i inne koszty	6	681,348.95	-
Niezrealizowana strata z kontraktów walutowych	3.4, 11	423,495.79	-
Niezrealizowana strata z kontraktów futures	3.5, 12	-	-
Niezrealizowana strata z kontraktów swap stóp procentowych	3.7, 15	-	-
Inne wymagane płatności		-	-

### Pasywa ogółem

**2,101,013.93**

### Aktywa netto razem

**653,506,172.64**



# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

---

## Zestawienie aktywów netto na dzień 30 czerwca 2022 roku (c.d.)

		SANTANDER AM AKCJI EUROPEJSKICH
	Noty	EUR
<b>AKTYWA</b>		
Inwestycje w papiery wartościowe po cenie rynkowej	3.1	430,031,055.49
Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 14	-
Opcje kupione po cenie rynkowej	3.6, 13	-
Swapy total return po cenie rynkowej	3.9, 16	-
Środki pieniężne w banku	3.1	4,541,991.06
Środki pieniężne u brokera	3.1	6,997,554.32
Należności z tytułu sprzedaży papierów wartościowych		-
Należności z subskrypcji		-
Należności z tytułu odsetek i dywidend netto	3.11	326,463.72
Rozliczenia międzyokresowe kosztów	3.12	10,508.88
Niezrealizowany zysk netto z kontraktów term. forward	3.4, 11	-
Niezrealizowany zysk z kontraktów futures	3.5, 12	25,160.00
Niezrealizowany zysk z kontraktów swap stóp procentowych	3.7, 15	-
Inne należności		1,589,918.83
<b>Aktywa ogółem</b>		<b>443,522,652.30</b>
<b>PASYWA</b>		
Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 14	-
Wartość rynkowa opcji	3.6, 13	-
Swapy total return po cenie rynkowej	3.9, 16	-
Kredyt w rachunku bankowym	3.1	-
Kredyt w rachunku brokera	3.1	-
Zobowiązania z tytułu odsetek i dywidend netto	3.11	-
Zobowiązania z tytułu nabycia papierów wartościowych		-
Zobowiązania z tytułu umorzeń		1,207,525.70
Zobowiązania z tytułu podatków i inne koszty	6	524,160.26
Niezrealizowana strata z kontraktów walutowych	3.4, 11	-
Niezrealizowana strata z kontraktów futures	3.5, 12	-
Niezrealizowana strata z kontraktów swap stóp procentowych	3.7, 15	-
Inne wymagane płatności		-
<b>Pasywa ogółem</b>		<b>1,731,685.96</b>
<b>Aktywa netto razem</b>		<b>441,790,966.34</b>

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

---

## Zestawienie aktywów netto na dzień 30 czerwca 2022 roku (c.d.)

	Noty	SANTANDER GO GLOBALNYCH AKCJI ESG USD
<b>AKTYWA</b>		
Inwestycje w papiery wartościowe po cenie rynkowej	3.1	541,580,603.81
Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 14	-
Opcje kupione po cenie rynkowej	3.6, 13	-
Swapy total return po cenie rynkowej	3.9, 16	-
Środki pieniężne w banku	3.1	5,640,731.86
Środki pieniężne u brokera	3.1	-
Należności z tytułu sprzedaży papierów wartościowych		18,843,586.58
Należności z subskrypcji		274,550.98
Należności z tytułu odsetek i dywidend netto	3.11	68,956.38
Rozliczenia międzyokresowe kosztów	3.12	11,290.43
Niezrealizowany zysk netto z kontraktów term. forward	3.4, 11	171.94
Niezrealizowany zysk z kontraktów futures	3.5, 12	-
Niezrealizowany zysk z kontraktów swap stóp procentowych	3.7, 15	-
Inne należności		1,831,644.97
<b>Aktywa ogółem</b>		<b>568,251,536.95</b>
<b>PASYWA</b>		
Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 14	-
Wartość rynkowa opcji	3.6, 13	-
Swapy total return po cenie rynkowej	3.9, 16	-
Kredyt w rachunku bankowym	3.1	-
Kredyt w rachunku brokera	3.1	-
Zobowiązania z tytułu odsetek i dywidend netto	3.11	-
Zobowiązania z tytułu nabycia papierów wartościowych		8,865,404.37
Zobowiązania z tytułu umorzeń		4,371,401.19
Zobowiązania z tytułu podatków i inne koszty	6	542,984.46
Niezrealizowana strata z kontraktów walutowych	3.4, 11	1,298,300.75
Niezrealizowana strata z kontraktów futures	3.5, 12	-
Niezrealizowana strata z kontraktów swap stóp procentowych	3.7, 15	-
Inne wymagane płatności		10,096.27
<b>Pasywa ogółem</b>		<b>15,088,187.04</b>
<b>Aktywa netto razem</b>		<b>553,163,349.91</b>

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

---

## Zestawienie aktywów netto na dzień 30 czerwca 2022 roku (c.d.)

	Noty	SANTANDER GO DYNAMIC BOND USD
<b>AKTYWA</b>		
Inwestycje w papiery wartościowe po cenie rynkowej	3.1	142,311,493.57
Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 14	200,496.33
Opcje kupione po cenie rynkowej	3.6, 13	650,324.31
Swapy total return po cenie rynkowej	3.9, 16	-
Środki pieniężne w banku	3.1	5,855,020.41
Środki pieniężne u brokera	3.1	1,480,083.45
Należności z tytułu sprzedaży papierów wartościowych		15,539,762.66
Należności z subskrypcji		354,670.32
Należności z tytułu odsetek i dywidend netto	3.11	739,284.83
Wydatki opłacone z góry	3.12	7,040.30
Niezrealizowany zysk netto z kontraktów term. forward	3.4, 11	2,870,943.60
Niezrealizowany zysk z kontraktów futures	3.7, 12	216,404.08
Niezrealizowany zysk z kontraktów swap stóp procentowych	3.7, 15	3,769,334.47
Inne należności		2,215.55
<b>Aktywa ogółem</b>		<b>173,997,073.88</b>
<b>PASYWA</b>		
Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 14	632,445.14
Wartość rynkowa opcji	3.6, 13	2,200,800.96
Swapy total return po cenie rynkowej	3.9, 16	-
Kredyt w rachunku bankowym	3.1	635,789.88
Kredyt w rachunku brokera	3.1	7,757.34
Zobowiązania z tytułu odsetek i dywidend netto	3.11	4,962.13
Zobowiązania z tytułu nabycia papierów wartościowych		28,142,818.65
Zobowiązania z tytułu umorzeń		1,706,692.83
Zobowiązania z tytułu podatków i inne koszty	6	369,460.38
Niezrealizowana strata z kontraktów walutowych	3.4, 11	806,691.30
Niezrealizowana strata z kontraktów futures	3.5, 12	861,378.02
Niezrealizowana strata z kontraktów swap stóp proc.	3.7, 15	4,467,355.39
Inne wymagane płatności		-
<b>Pasywa ogółem</b>		<b>39,836,152.02</b>
		<b>134,160,921.86</b>

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

---

## Zestawienie aktywów netto na dzień 30 czerwca 2022 roku (c.d.)

SANTANDER  
FUTURE WEALTH

USD

Noty

### AKTYWA

Inwestycje w papiery wartościowe po cenie rynkowej	3.1	124,879,515.92
Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 14	-
Opcje kupione po cenie rynkowej	3.6, 13	-
Swapy total return po cenie rynkowej	3.9, 16	-
Środki pieniężne w banku	3.1	1,386,569.97
Środki pieniężne u brokera	3.1	711,062.64
Należności z tytułu sprzedaży papierów wartościowych		1,148,840.77
Należności z subskrypcji		310,269.65
Należności z tytułu odsetek i dywidend netto	3.11	-
Rozliczenia międzyokresowe kosztów	3.12	6,510.83
Niezrealizowany zysk netto z kontraktów term. forward	3.4, 11	1,954.95
Niezrealizowany zysk z kontraktów futures	3.5, 12	-
Niezrealizowany zysk z kontraktów swap stóp procentowych	3.7, 15	-
Inne należności		52,558.95

### Aktywa ogółem

**128,497,283.68**

### PASYWA

Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 14	-
Wartość rynkowa opcji	3.6, 13	-
Swapy total return po cenie rynkowej	3.9, 16	-
Kredyt w rachunku bankowym	3.1	-
Kredyt w rachunku brokera	3.1	0.01
Zobowiązania z tytułu odsetek i dywidend netto	3.11	-
Zobowiązania z tytułu nabycia papierów wartościowych		-
Zobowiązania z tytułu umorzeń		596,535.77
Zobowiązania z tytułu podatków i inne koszty	6	169,122.58
Niezrealizowana strata z kontraktów walutowych	3.4, 11	159,113.59
Niezrealizowana strata z kontraktów futures	3.5, 12	126,787.50
Niezrealizowana strata z kontraktów swap stóp procentowych	3.7, 15	-
Inne wymagane płatności		-

### Pasywa ogółem

**1,051,559.45**

### Aktywa netto razem

**127,445,724.23**

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

## Skonsolidowane zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za kończący się 30 czerwca 2022 roku

	Noty	EUR
<b>Wartość Aktywów Netto na początek okresu</b>		<b>7,034,970,731.14</b>
<b>DOCHODY</b>		
Dywidendy netto	3.11	24,808,103.83
Odsetki z tytułu obligacji netto	3.11	20,460,713.09
Odsetki bankowe netto	3.11	3,961.37
Odsetki od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	1,254,806.37
Inne dochody		150,801.18
		<b>46,678,385.84</b>
<b>KOSZTY</b>		
Opłaty za zarządzanie	5	23,254,902.13
Opłaty na rzecz depozytariusza	7	572,620.83
Odsetki bankowe netto	3.11	1,513,638.05
Odsetki od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	531,793.15
Podatek roczny	8	803,150.53
Amortyzacja wydatków na utworzenie subfunduszy	3.1	3,509.59
Koszty audytu i prawne		365,673.05
Koszty administracyjne	7	1,589,308.49
Inne koszty		2,740,315.20
		<b>31,374,911.03</b>

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

## Skonsolidowane zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za kończący się 30 czerwca 2022 roku

	Noty	EUR
<b>Zysk/(strata) netto z inwestycji:</b>		<b>15,303,474.81</b>
<b>Zrealizowany zysk/(strata) netto z tytułu:</b>		
- inwestycji	3.2	(293,318,677.76)
- operacji walutowych	3.3	811,217.21
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	22,253,593.63
- kontraktów futures	3.5	(12,558,607.29)
- opcji	3.6	13,360,380.36
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	(8,962,037.33)
<b>Zrealizowana strata netto za okres</b>		<b>(278,414,131.17)</b>
<b>Zmiana niezrealizowanego zysku/(straty) z tytułu:</b>		
- inwestycji	3.2	(1,217,272,982.43)
- operacji walutowych	3.3	(244,411.56)
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	(4,353,524.19)
- kontraktów futures	3.5	(8,078,302.85)
- opcji	3.6	(595,168.40)
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	(562,045.97)
		<b>(1,231,106,435.40)</b>
<b>Zysk/(strata) netto z operacji</b>		<b>(1,494,217,091.76)</b>
Nabycia	4	983,061,055.65
Umorzenia	4	(1,531,407,129.33)
Wyłacone dywidendy	2	(2,820,375.27)
Przeszacowanie waluty*	3.3	134,467,174.47
<b>Wartość Aktywów Netto na koniec okresu</b>		<b>5,124,054,364.89</b>

\* 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 2021 roku oraz kursach obowiązujących na dzień 30 czerwca 2022 roku.

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

---

## Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres kończący się 30 czerwca 2022 roku

	Noty	SANTANDER GO AKCJI PÓŁNOCNO AMERYKAŃSKICH USD
<b>Wartość Aktywów Netto na początek okresu</b>		<b>1,911,301,688.27</b>
<b>DOCHODY</b>		
Dywidendy netto	3.11	884,911.64
Odsetki z tytułu obligacji netto	3.11	-
Odsetki bankowe netto	3.11	-
Odsetki netto od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
Inne dochody		-
<b>Dochody ogółem</b>		<b>884,911.64</b>
<b>KOSZTY</b>		
Opłaty za zarządzanie	5	3,929,830.85
Opłaty na rzecz depozytariusza	7	56,031.52
Odsetki bankowe netto	3.11	43,942.71
Odsetki netto od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
Podatek roczny	8	91,257.08
Amortyzacja wydatków na utworzenie subfunduszy	3.1	-
Koszty audytu i prawne		27,679.46
Koszty administracyjne	7	261,197.19
Inne koszty		241,952.29
<b>Koszty ogółem</b>		<b>4,651,891.10</b>

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

---

## Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres kończący się 30 czerwca 2022 roku

	Noty	SANTANDER GO AKCJI PÓŁNOCNO AMERYKAŃSKICH USD
<b>Zysk/(strata) netto z inwestycji</b>		<b>(3,766,979.46)</b>
<b>Zrealizowany zysk/(strata) netto z tytułu:</b>		
- inwestycji	3.2	(226,943,707.76)
- operacji walutowych	3.3	203,338.18
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	3,287,991.90
- kontraktów futures	3.5	-
- opcji	3.6	(3,083,383.41)
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
<b>Zrealizowany zysk/(strata) netto za okres</b>		<b>(226,535,761.09)</b>
<b>Zmiana niezrealizowanego zysku/(straty) z tytułu:</b>		
- inwestycji	3.2	(711,656,998.66)
- operacji walutowych	3.3	(71,518.63)
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	(1,985,276.88)
- kontraktów futures	3.5	-
- opcji	3.6	1,281,057.80
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
<b>Zmiana niezrealizowanego zysku/(straty) w okresie</b>		<b>(712,432,736.37)</b>
<b>Zysk/(strata) netto z operacji</b>		<b>(942,735,476.92)</b>
Nabycia	4	79,807,024.93
Umorzenia	4	(394,867,063.64)
Wyłacone dywidendy	2	-
<b>Wartość Aktywów Netto na koniec okresu</b>		<b>653,506,172.64</b>



# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

---

## Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres kończący się 30 czerwca 2022 roku

	Noty	SANTANDER AM AKCJI EUROPEJSKICH EUR
<b>Wartość Aktywów Netto na początek okresu</b>		<b>670,102,317.25</b>
<b>DOCHODY</b>		
Dywidendy netto	3.11	11,713,200.61
Odsetki z tytułu obligacji netto	3.11	-
Odsetki bankowe netto	3.11	-
Odsetki netto od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
Inne dochody		-
<b>Dochody ogółem</b>		<b>11,713,200.61</b>
<b>KOSZTY</b>		
Opłaty za zarządzanie	5	622,066.41
Opłaty na rzecz depozytariusza	7	23,695.61
Odsetki bankowe netto	3.11	150,939.17
Odsetki netto od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
Podatek roczny	8	31,855.43
Amortyzacja wydatków na utworzenie subfunduszy	3.1	-
Koszty audytu i prawne		26,221.86
Koszty administracyjne	7	176,034.70
Inne koszty		187,307.14
<b>Koszty ogółem</b>		<b>1,218,120.32</b>

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

---

## Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres kończący się 30 czerwca 2022 roku

	Noty	SANTANDER AM AKCJI EUROPEJSKICH EUR
<b>Zysk/(strata) netto z inwestycji</b>		<b>10,495,080.29</b>
<b>Zrealizowany zysk/(strata) netto z tytułu:</b>		
- inwestycji	3.2	20,805,188.64
- operacji walutowych	3.3	188,000.85
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	-
- kontraktów futures	3.5	754,063.03
- opcji	3.6	-
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
<b>Zrealizowany zysk/(strata) netto za okres</b>		<b>21,747,252.52</b>
<b>Zmiana niezrealizowanego zysku/(straty) z tytułu:</b>		
- inwestycji	3.2	(137,180,882.63)
- operacji walutowych	3.3	(28,553.14)
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	-
- kontraktów futures	3.5	(451,034.51)
- opcji	3.6	-
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
<b>Zmiana niezrealizowanego zysku/(straty) w okresie</b>		<b>(137,660,470.28)</b>
<b>Zysk/(strata) netto z operacji</b>		<b>(105,418,137.47)</b>
Nabycia	4	23,055,918.01
Umorzenia	4	(145,949,131.45)
Wyłacone dywidendy	2	-
<b>Wartość Aktywów Netto na koniec okresu</b>		<b>441,790,966.34</b>

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

---

## Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres kończący się 30 czerwca 2022 roku

	Noty	SANTANDER GO GLOBALNYCH AKCJI ESG USD
<b>Wartość Aktywów Netto na początek okresu</b>		<b>681,950,942.00</b>
<b>DOCHODY</b>		
Dywidendy netto	3.11	4,616,175.10
Odsetki z tytułu obligacji netto	3.11	-
Odsetki bankowe netto	3.11	-
Odsetki netto od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
Inne dochody		-
<b>Dochody ogółem</b>		<b>4,616,175.10</b>
<b>KOSZTY</b>		
Opłaty za zarządzanie	5	2,524,592.28
Opłaty na rzecz depozytariusza	7	14,321.91
Odsetki bankowe netto	3.11	904.89
Odsetki netto od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
Podatek roczny	8	80,746.06
Amortyzacja wydatków na utworzenie subfunduszy	3.1	-
Koszty audytu i prawne		56,737.75
Koszty administracyjne	7	187,824.25
Inne koszty		137,887.96
<b>Koszty ogółem</b>		<b>3,003,015.10</b>

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

---

## Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres kończący się 30 czerwca 2022 roku

SANTANDER GO  
GLOBALNYCH AKCJI  
ESG USD

	Noty	
<b>Zysk/(strata) netto z inwestycji</b>		<b>1,613,160.00</b>
<b>Zrealizowany zysk/(strata) netto z tytułu:</b>		
- inwestycji	3.2	(30,765,751.84)
- operacji walutowych	3.3	78,032.65
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	21,486,539.26
- kontraktów futures	3.5	-
- opcji	3.6	-
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
<b>Zrealizowany zysk/(strata) netto za okres</b>		<b>(9,201,179.93)</b>
<b>Zmiana niezrealizowanego zysku/(straty) z tytułu:</b>		
- inwestycji	3.2	(117,463,471.02)
- operacji walutowych	3.3	(22,374.07)
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	(4,136,010.82)
- kontraktów futures	3.5	-
- opcji	3.6	-
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
<b>Zmiana niezrealizowanego zysku/(straty) w okresie</b>		<b>(121,621,855.91)</b>
<b>Zysk/(strata) netto z operacji</b>		<b>(129,209,875.84)</b>
Nabycia	4	207,063,221.48
Umorzenia	4	(206,640,937.73)
Wyłacone dywidendy	2	-
<b>Wartość Aktywów Netto na koniec okresu</b>		<b>553,163,349.91</b>

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

---

## Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres kończący się 30 czerwca 2022 roku

	Noty	SANTANDER GO DYNAMIC BOND	USD
<b>Wartość Aktywów Netto na początek okresu</b>		<b>251,406,613.67</b>	
<b>DOCHODY</b>			
Dywidendy netto	3.11	-	
Odsetki z tytułu obligacji netto	3.11	2,133,300.93	
Odsetki bankowe netto	3.11	2,763.12	
Odsetki netto od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	199,871.44	
Inne dochody		2,953.54	
<b>Dochody ogółem</b>		<b>2,338,889.03</b>	
<b>KOSZTY</b>			
Opłaty za zarządzanie	5	774,620.94	
Opłaty na rzecz depozytariusza	7	131,416.95	
Odsetki bankowe netto	3.11	8.47	
Odsetki netto od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-	
Podatek roczny	8	21,283.44	
Amortyzacja wydatków na utworzenie subfunduszy	3.1	-	
Koszty audytu i prawne		17,213.41	
Koszty administracyjne	7	72,205.91	
Inne koszty		92,453.17	
<b>Koszty ogółem</b>		<b>1,109,202.29</b>	

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

---

## Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres kończący się 30 czerwca 2022 roku

SANTANDER GO  
DYNAMIC BOND

	Noty		USD
<b>Zysk/(strata) netto z inwestycji</b>		<b>1,229,686.74</b>	
<b>Zrealizowany zysk/(strata) netto z tytułu:</b>			
- inwestycji	3.2	(5,576,257.85)	
- operacji walutowych	3.3	(2,754,254.03)	
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	(919,617.29)	
- kontraktów futures	3.5	1,514,065.97	
- opcji	3.6	239,946.88	
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	(2,900,805.00)	
<b>Zrealizowany zysk/(strata) netto za okres</b>		<b>(10,396,921.32)</b>	
<b>Zmiana niezrealizowanego zysku/(straty) z tytułu:</b>			
- inwestycji	3.2	(15,652,327.34)	
- operacji walutowych	3.3	(11,785.76)	
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	1,343,234.88	
- kontraktów futures	3.5	(383,571.13)	
- opcji	3.6	(1,204,609.66)	
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	(80,636.19)	
<b>Zmiana niezrealizowanego zysku/(straty) w okresie</b>		<b>(15,989,695.20)</b>	
<b>Zysk/(strata) netto z operacji</b>		<b>(25,156,929.78)</b>	
Nabycia	4	8,383,837.95	
Umorzenia	4	(100,472,599.98)	
Wyłacone dywidendy	2	-	
<b>Wartość Aktywów Netto na koniec okresu</b>		<b>134,160,921.86</b>	

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

---

## Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres kończący się 30 czerwca 2022 roku

	Noty	SANTANDER FUTURE WEALTH USD
<b>Wartość Aktywów Netto na początek okresu</b>		<b>228,961,238.04</b>
<b>DOCHODY</b>		
Dywidendy netto	3.11	76,679.67
Odsetki z tytułu obligacji netto	3.11	-
Odsetki bankowe netto	3.11	-
Odsetki netto od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
Inne dochody		131,529.74
<b>Dochody ogółem</b>		<b>208,209.41</b>
<b>KOSZTY</b>		
Opłaty za zarządzanie	5	663,728.40
Opłaty na rzecz depozytariusza	7	3,483.19
Odsetki bankowe netto	3.11	23,066.31
Odsetki netto od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
Podatek roczny	8	4,529.88
Amortyzacja wydatków na utworzenie subfunduszy	3.1	-
Koszty audytu i prawne		20,512.31
Koszty administracyjne	7	82,030.66
Inne koszty		49,285.70
<b>Koszty ogółem</b>		<b>846,636.45</b>

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

---

## Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres kończący się 30 czerwca 2022 roku

			SANTANDER FUTURE WEALTH *
	Noty		USD
<b>Zysk/(strata) z inwestycji</b>		<b>(638,427.04)</b>	
<b>Zrealizowany zysk/(strata) netto z tytułu:</b>			
- inwestycji	3.2	(14,683,535.06)	
- operacji walutowych	3.3	(390,636.27)	
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	3,545,101.92	
- kontraktów futures	3.5	(1,453,246.48)	
- opcji	3.6	-	
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-	
<b>Zrealizowany zysk/(strata) netto za okres</b>		<b>(12,982,315.89)</b>	
<b>Zmiana niezrealizowanego zysku/(straty) z tytułu:</b>			
- inwestycji	3.2	(40,185,851.88)	
- operacji walutowych	3.3	(31,406.02)	
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	(598,124.50)	
- kontraktów futures	3.5	(211,727.50)	
- opcji	3.6	-	
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-	
<b>Zmiana niezrealizowanego zysku/(straty) w okresie</b>		<b>(41,027,109.90)</b>	
<b>Zysk/(strata) netto z operacji</b>		<b>(54,647,852.83)</b>	
Nabycia	4	31,891,767.26	
Umorzenia	4	(78,759,428.24)	
Wyłacone dywidendy	2	-	
<b>Wartość Aktywów Netto na koniec okresu</b>		<b>127,445,724.23</b>	



# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

## Dane statystyczne (c.d.)

### SANTANDER GO AKCJI PÓŁNOCNO AMERYKAŃSKICH

		30 czerwca 2022	31 grudnia 2021	31 grudnia 2020
<b>Wartość Aktywów Netto</b>	<b>USD</b>	<b>653,506,172.64</b>	<b>1,911,301,688.27</b>	<b>1,439,913,046.80</b>
<b>Klasa A</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		911,328.07	1,112,053.37	948,611.93
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	15.66	33.71	35.28
<b>Klasa B</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		5,147,995.46	7,176,728.27	6,518,021.46
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	17.93	38.46	39.97
<b>Klasa BEH</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		384,889.35	518,566.42	441,402.95
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	71.27	155.83	163.73
<b>Klasa C</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		1,578,676.01	1,333,974.48	706,564.09
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	8.04	17.26	17.96
<b>Klasa I</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		2,754,950.36	12,488,208.53	11,809,804.82
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	8.27	17.67	18.22
<b>Klasa M</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		1,719,675.22	2,019,039.22	1,455,034.42
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	81.26	173.56	178.75
<b>Klasa ME</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		3,144,140.61	3,835,592.46	2,330,846.26
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	97.65	191.73	183.53
<b>Klasa RKP</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		829.37	64.09	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	GBP	51.34	98.54	-
<b>Klasa SE</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		3,401.63	3,903.54	5,180.67
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	82.60	162.28	155.56
<b>Klasa V</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		274,695.46	486,172.99	272,477.41
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	79.09	153.85	165.60

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

## Dane statystyczne (c.d.)

### SANTANDER AM AKCJI EUROPEJSKICH

		30 czerwca 2022	31 grudnia 2021	31 grudnia 2020
<b>Wartość Aktywów Netto</b>	<b>EUR</b>	<b>441,790,966.34</b>	<b>670,102,317.25</b>	<b>536,288,506.00</b>
<b>Klasa A</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		205,200.03	203,098.10	188,634.41
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	162.88	201.08	164.55
<b>Klasa AU</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		3,286.30	3,075.10	1,519.43
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	95.04	127.95	113.20
<b>Klasa B</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		40,286.57	43,197.97	8,532.14
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	119.28	146.89	119.61
<b>Klasa I</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		9,658.10	13,352.12	9,153.71
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	1,531.05	1,876.63	1,513.75
<b>Klasa IKP</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		6,792.94	44,999.48	51,202.48
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	GBP	1,817.98	2,172.27	1,861.56
<b>Klasa M</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		3,581,800.01	3,768,078.14	3,746,568.56
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	104.45	127.68	102.43

**SANTANDER SICAV**

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

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

		30 czerwca 2022	31 grudnia 2021	31 grudnia 2020
<b>Wartość Aktywów Netto</b>	<b>USD</b>	<b>553,163,349.91</b>	<b>681,950,942.00</b>	<b>158,259,748.20</b>
<b>Klasa A</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		39,202.75	39,276.89	5,455.79
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	103.72	129.63	102.70
<b>Klasa AE</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		328,429.06	250,156.68	55,001.52
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	154.69	177.74	130.88
<b>Klasa B</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		342,495.96	430,165.19	64,359.88
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	105.07	131.06	103.42
<b>Klasa BE</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		607,496.43	383,711.76	36,359.13
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	156.11	179.01	131.30
<b>Klasa BEH</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		307,593.46	187,677.74	28,946.35
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	100.90	127.41	101.49
<b>Klasa I</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		277,688.51	66,538.06	216,798.76
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	105.96	131.75	103.28
<b>Klasa IKP</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		45,000.00	45,000.00	45,000.00
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	GBP	109.37	122.00	94.73
<b>Klasa M</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		1,608,162.62	2,055,769.79	853,653.47
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	108.86	135.25	105.88
<b>Klasa RKP</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		8,077,885.32	4,908,981.26	293,187.71
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	GBP	1.21	1.35	1.05
<b>Klasa SE</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		447.95	2,992.74	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	102.05	116.62	-
<b>Klasa V</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		718,139.67	968,694.14	101,464.13
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	147.65	166.22	135.77

## Dane statystyczne (c.d.)

		30 czerwca 2022	31 grudnia 2021	31 grudnia 2020
<b>Wartość Aktywów Netto</b>	<b>USD</b>	<b>134,160,921.86</b>	<b>251,406,613.67</b>	<b>94,245,368.27</b>
<b>Klasa A</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		20,509.93	14,555.72	196.90
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	93.54	102.95	104.53
<b>Klasa B</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		327,479.21	471,184.13	220,352.77
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	94.39	103.71	104.92
<b>Klasa BEH</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		244,320.26	302,821.64	50.00
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	89.18	98.74	100.74
<b>Klasa I</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		-	463,190.00	463,190.00
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	-	105.23	100.73
<b>Klasa IEH</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		22,184.28	32,358.84	26,161.60
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	89.76	99.01	100.33
<b>Klasa M</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		453,739.26	700,372.44	187,356.31
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	92.01	100.65	100.95
<b>Klasa MEH</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		370,438.18	395,483.80	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	89.60	98.83	-
<b>Klasa RKP</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		197.44	76.56	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	GBP	102.43	101.09	-

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

## Dane statystyczne (c.d.)

## SANTANDER FUTURE WEALTH

		30 czerwca 2022	31 grudnia 2021	31 grudnia 2020
<b>Wartość Aktywów Netto</b>	<b>USD</b>	<b>127,445,724.23</b>	<b>228,961,238.04</b>	<b>-</b>
<b>Klasa A</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		548,031.91	892,726.56	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	73.71	101.83	-
<b>Klasa AE</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		238,719.57	221,950.09	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	85.76	108.93	-
<b>Klasa AEH</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		50.00	50.00	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	69.04	96.72	-
<b>Klasa APH</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		824.32	50.00	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	GBP	70.57	98.51	-
<b>Klasa M</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		209,388.54	321,787.30	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	74.50	102.24	-
<b>Klasa RKP</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		881.98	508.04	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	GBP	84.50	104.42	-
<b>Klasa V</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		209,571.19	279,603.21	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	74.82	93.63	-
<b>Klasa X</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		321,515.57	385,843.23	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	73.87	101.48	-
<b>Klasa XE</b>				
Liczba wyemitowanych tytułów		112,697.21	96,116.27	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	88.73	112.06	-

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

## SANTANDER GO AKCJI PÓŁNOCNOAMERYKAŃSKICH

### Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2022 r.

Waluta	Ilość	Opis	Koszt USD	Wartość rynkowa USD	% WAN
<b>Zbywalne papiery wartościowe dopuszczone do oficjalnego notowania na giełdzie lub znajdujące się w obrocie na innym rynku regulowanym - ogółem</b>					
<b>Akcje</b>					
<b>Kanada</b>					
CAD	960,990.00	SHOPIFY INC COMMON STOCK	76,798,112.84	30,021,327.60	4.59%
<b>Kanada razem</b>			<b>76,798,112.84</b>	<b>30,021,327.60</b>	<b>4.59%</b>
<b>Szwecja</b>					
USD	118,939.00	SPOTIFY TECHNOLOGY SA	26,702,136.24	11,160,046.37	1.71%
<b>Szwecja razem</b>			<b>26,702,136.24</b>	<b>11,160,046.37</b>	<b>1.71%</b>
<b>Holandia</b>					
EUR	13,691.00	ADYEN NV COMMON STOCK	25,450,646.19	19,866,799.01	3.04%
USD	64,409.00	ASML HOLDING NV NY REG	40,059,868.60	30,650,954.92	4.69%
<b>Holandia razem</b>			<b>65,510,514.79</b>	<b>50,517,753.93</b>	<b>7.73%</b>
<b>Wielka Brytania</b>					
USD	707,084.00	FARFETCH LTD COMMON	31,950,157.90	5,062,721.44	0.77%
USD	1,183,265.00	ROYALTY PHARMA PLC	50,776,036.76	49,744,460.60	7.61%
<b>Wielka Brytania razem</b>			<b>82,726,194.66</b>	<b>54,807,182.04</b>	<b>8.38%</b>
<b>Stany Zjednoczone</b>					
USD	190,225.00	AIRBNB INC COMMON STOCK	31,548,689.17	16,945,243.00	2.59%
USD	306,365.00	AMAZON.COM INC COMMON	39,760,138.58	32,539,026.65	4.98%
USD	322,935.00	BLOCK INC COMMON STOCK	45,655,278.41	19,847,585.10	3.04%
USD	691,648.00	CHEWY INC COMMON STOCK	37,689,478.40	24,014,018.56	3.67%
USD	718,505.00	CLOUDFLARE INC COMMON	62,648,225.91	31,434,593.75	4.81%
USD	100,550.00	COINBASE GLOBAL INC	23,038,262.76	4,727,861.00	0.72%
USD	163,601.00	COUPA SOFTWARE INC	33,520,745.43	9,341,617.10	1.43%
USD	357,224.00	DATADOG INC	38,873,830.00	34,022,013.76	5.21%
USD	137,685.00	IAC/INTERACTIVECORP	16,624,799.94	10,459,929.45	1.60%
USD	32,432.00	ILLUMINA INC COMMON	10,725,294.44	5,979,163.52	0.91%
USD	34,853.00	INTUITIVE SURGICAL INC	7,486,822.63	6,995,345.63	1.07%
USD	102,157.00	MATCH GROUP INC COMMON	12,166,759.23	7,119,321.33	1.09%
USD	19,152.00	MERCADOLIBRE INC COMMON	24,258,871.71	12,197,334.24	1.87%
USD	86,176.00	OKTA INC COMMON STOCK	15,528,053.46	7,790,310.40	1.19%
USD	957,962.00	ROBLOX CORP COMMON STOCK	76,198,170.05	31,478,631.32	4.82%
USD	345,277.00	SNOWFLAKE INC COMMON	84,106,188.82	48,014,219.62	7.35%
USD	806,851.00	TRADE DESK INC/THE	62,043,058.34	33,798,988.39	5.17%
USD	76,869.00	TWILIO INC COMMON STOCK	20,832,280.16	6,442,390.89	0.99%
USD	1,952,042.00	UBER TECHNOLOGIES INC	89,201,573.09	39,938,779.32	6.11%
USD	417,748.00	UNITY SOFTWARE INC	62,306,134.10	15,381,481.36	2.35%
USD	215,817.00	VEEVA SYSTEMS INC COMMON	51,187,341.38	42,740,398.68	6.54%
USD	174,814.00	WAYFAIR INC COMMON STOCK	51,268,048.84	7,614,897.84	1.17%
USD	229,852.00	ZOOM VIDEO	67,761,738.61	24,817,120.44	3.80%
USD	933,195.00	ZOOMINFO TECHNOLOGIES	49,699,931.54	31,019,401.80	4.75%

Informacje dodatkowe stanowią integralną część niniejszych sprawozdań finansowych

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

---

Stany Zjednoczone razem	<u>1,014,129,715.00</u>	<u>504,659,673.15</u>	77.23%
Akcje ogółem	<u>1,265,866,673.53</u>	<u>651,165,983.09</u>	99.64%
Zbywalne papiery wartościowe dopuszczone do oficjalnego notowania na giełdzie lub znajdujące się w obrocie na innym rynku regulowanym - ogółem	<u>1,265,866,673.53</u>	<u>651,165,983.09</u>	99.64%
Inwestycje ogółem	<u>1,265,866,673.53</u>	<u>651,165,983.09</u>	99.64%

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER GO AKCJI PÓLNOCNOAMERYKAŃSKICH

---

## Klasyfikacja geograficzna inwestycji na dzień 30 czerwca 2022 r.

	% WAN
Stany Zjednoczone	77.22%
Wielka Brytania	8.39%
Holandia	7.73%
Kanada	4.59%
Szwecja	1.71%
<b>Razem</b>	<b>99.64%</b>

## Ekonomiczna klasyfikacja inwestycji na dzień 30 czerwca 2022 r.

	% WAN
Różne	32.89%
Przetwarzanie danych	24.04%
Zdrowotne/osobiste	14.15%
Merchandising	12.46%
Transport (żegluga)	6.11%
Komponenty elektroniczne	4.69%
Wypoczynek / turystyka	2.59%
Elektryczne i elektronika	1.99%
Usługi finansowe	0.72%
<b>Razem</b>	<b>99.64%</b>

---



## Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2022 r.

Waluta	Ilość	Opis	Koszt EUR	Wartość rynkowa EUR	% WAN
<b>Zbywalne papiery wartościowe dopuszczone do oficjalnego notowania na giełdzie lub znajdujące się w obrocie na innym rynku regulowanym – ogółem</b>					
<b>Akcje</b>					
<b>Belgia</b>					
EUR	114,247.00	ANHEUSER-BUSCH INBEV	6,861,281.68	5,867,725.92	1.33%
<b>Belgia razem</b>			<b>6,861,281.68</b>	<b>5,867,725.92</b>	<b>1.33%</b>
<b>Finlandia</b>					
EUR	1,683,630.0	NOKIA OYJ COMMON STOCK	7,975,474.85	7,474,475.39	1.69%
EUR	299,450.0	UPM-KYMMENE OYJ COMMON	8,003,119.28	8,687,044.50	1.97%
<b>Finlandia razem</b>			<b>15,978,594.13</b>	<b>16,161,519.89</b>	<b>3.66%</b>
<b>Francja</b>					
EUR	68,586.00	AIR LIQUIDE SA COMMON	9,579,301.67	8,787,238.32	1.99%
EUR	587,232.00	AXA SA COMMON STOCK EUR	14,267,618.16	12,719,445.12	2.88%
EUR	146,561.00	BNP PARIBAS SA COMMON	6,887,446.57	6,648,739.77	1.50%
EUR	73,820.00	CAPGEMINI SE COMMON	7,955,610.80	12,065,879.00	2.73%
EUR	612,827.00	CARREFOUR SA COMMON	9,802,816.22	10,347,583.90	2.34%
EUR	183,183.00	CIE DE SAINT-GOBAIN	7,619,623.18	7,500,427.94	1.70%
EUR	252,968.00	CIE GENERALE DES	6,343,025.12	6,570,843.80	1.49%
EUR	49,888.00	ESSILORLUXOTTICA SA	7,331,398.97	7,128,995.20	1.61%
EUR	132,595.00	FAURECIA SE COMMON STOCK	6,011,637.68	2,508,034.43	0.57%
EUR	40,457.00	LVMH MOET HENNESSY LOUIS	14,388,308.94	23,533,836.90	5.33%
EUR	123,835.00	PUBLICIS GROUPE SA	5,164,749.62	5,778,141.10	1.31%
EUR	197,356.00	SANOFI COMMON STOCK EUR	15,935,369.63	19,013,277.04	4.30%
EUR	101,010.00	SODEXO SA COMMON STOCK	7,714,534.21	6,773,730.60	1.53%
EUR	32,776.00	TELEPERFORMANCE COMMON	5,633,971.91	9,613,200.80	2.18%
EUR	494,642.00	TOTALENERGIES SE COMMON	18,331,341.29	24,915,117.54	5.62%
EUR	88,064.00	VINCI SA COMMON STOCK	7,747,356.41	7,481,917.44	1.69%
<b>Francja razem</b>			<b>150,714,110.38</b>	<b>171,386,408.90</b>	<b>38.77%</b>
<b>Niemcy</b>					
EUR	25,693.00	ADIDAS AG COMMON STOCK	6,967,390.64	4,335,950.68	0.98%
EUR	139,387.00	BAYER AG	9,196,152.71	7,906,030.64	1.79%
EUR	163,485.00	DAIMLER AG COMMON STOCK	9,905,167.46	9,027,641.70	2.04%
EUR	86,052.00	DEUTSCHE BOERSE AG	12,465,203.82	12,465,203.82	3.11%
EUR	338,311.00	DEUTSCHE POST AG COMMON	9,202,624.69	12,091,235.14	2.74%
EUR	542,533.00	DEUTSCHE TELEKOM AG	8,136,009.79	10,278,830.22	2.33%
EUR	204,114.00	FRESENIUS SE & CO KGAA	8,081,784.97	5,898,894.60	1.34%
EUR	188,976.00	INFINEON TECHNOLOGIES AG	4,540,838.13	4,363,455.84	0.99%
EUR	83,482.00	KION GROUP AG COMMON	5,667,782.05	3,305,052.38	0.75%
EUR	29,592.00	MUENCHENER	7,479,516.71	6,634,526.40	1.50%
EUR	248,270.00	RWE AG COMMON STOCK EUR	10,161,698.14	8,709,311.60	1.97%
EUR	88,929.00	SIEMENS AG COMMON STOCK	8,222,068.34	8,634,116.61	1.95%
<b>Niemcy razem</b>			<b>100,026,237.45</b>	<b>94,918,945.01</b>	<b>21.49%</b>
<b>Irlandia</b>					
USD	50,984.00	LINDE PLC COMMON STOCK	10,129,048.96	13,967,066.80	3.16%
<b>Irlandia razem</b>			<b>10,129,048.96</b>	<b>13,967,066.80</b>	<b>3.16%</b>

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

## SANTANDER AM AKCJI EUROPEJSKICH

<b>Włochy</b>					
EUR	1,271,305.00	ENEL SPA COMMON STOCK	8,102,136.25	6,636,212.10	1.50%
EUR	2,101,589.00	INTESA SANPAOLO SPA	4,686,295.98	3,740,828.42	0.85%
EUR	564,188.00	UNICREDIT SPA COMMON	8,541,487.75	5,114,364.22	1.16%
<b>Włochy razem</b>			<b>21,329,919.98</b>	<b>15,491,404.74</b>	<b>3.51%</b>
<b>Portugalia</b>					
EUR	2,125,459.00	EDP - ENERGIAS DE	7,525,827.83	9,462,543.47	2.14%
<b>Portugalia razem</b>			<b>7,525,827.83</b>	<b>9,462,543.47</b>	<b>2.14%</b>
<b>Hiszpania</b>					
EUR	703,501.00	ACERINOX SA COMMON STOCK	6,589,057.53	6,497,535.24	1.47%
EUR	3,273,425.00	BANCO SANTANDER SA	12,136,905.40	8,798,966.40	1.99%
EUR	163,678.00	CELLNEX TELECOM SA	7,144,121.01	6,060,996.34	1.37%
EUR	435,511.00	IBERDROLA SA COMMON	4,922,382.33	4,309,816.86	0.98%
EUR	265,112.00	INDUSTRIA DE DISEÑO	6,859,099.05	5,723,768.08	1.30%
EUR	505,064.00	REPSOL SA COMMON STOCK	6,205,453.70	7,096,149.20	1.61%
<b>Hiszpania razem</b>			<b>43,857,019.02</b>	<b>38,487,232.12</b>	<b>8.72%</b>
<b>Holandia</b>					
EUR	2,096.00	ADYEN NV COMMON STOCK	5,268,937.74	2,909,248.00	0.66%
EUR	135,539.00	AIRBUS SE COMMON STOCK	14,659,127.42	12,530,580.55	2.84%
EUR	28,193.00	ASML HOLDING NV COMMON	7,353,504.04	12,851,779.05	2.91%
EUR	465,457.00	ING GROEP NV COMMON	4,340,293.13	4,389,724.97	0.99%
EUR	38,205.00	KONINKLIJKE DSM NV	6,667,709.76	5,237,905.50	1.19%
EUR	105,804.00	SIGNIFY NV COMMON STOCK	2,655,081.86	3,346,580.52	0.76%
EUR	471,131.00	STELLANTIS NV COMMON	6,039,718.40	5,550,865.44	1.26%
EUR	333,400.00	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	8,157,410.49	6,379,275.60	1.44%
<b>Holandia razem</b>			<b>55,141,782.8</b>	<b>53,195,959.63</b>	<b>12.05%</b>
<b>Wielka Brytania</b>					
EUR	446,458.00	SHELL PLC COMMON STOCK	8,983,312.83	11,092,249.01	2.51%
<b>Wielka Brytania razem</b>			<b>8,983,312.83</b>	<b>11,092,249.01</b>	<b>2.51%</b>
<b>Akcje ogółem</b>			<b>420,547,135.10</b>	<b>430,031,055.49</b>	<b>97.34%</b>
<b>Zbywalne papiery wartościowe dopuszczone do oficjalnego notowania na giełdzie lub znajdujące się w obrocie na innym rynku regulowanym - ogółem</b>			<b>420,547,135.10</b>	<b>430,031,055.49</b>	<b>97.34%</b>
<b>Inwestycje ogółem</b>			<b>420,547,135.10</b>	<b>430,031,055.49</b>	<b>97.34%</b>

**Klasyfikacja geograficzna inwestycji na dzień 30 czerwca 2022 r.**

	% WAN
Francja	38.79%
Niemcy	21.49%
Holandia	12.04%
Hiszpania	8.71%
Finlandia	3.66%
Włochy	3.51%
Irlandia	3.16%
Wielka Brytania	2.51%
Portugalia	2.14%
Belgia	1.33%
	<b>97.34%</b>

**Ekonomiczna klasyfikacja inwestycji na dzień 30 czerwca 2022 r.**

	% WAN
Źródła energii	9.76%
Tekstylna / odzież	7.92%
Zdrowotne / osobiste	7.43%
Media (usług komunalne)	6.59%
Bankowość	6.49%
Przemysł chemiczny	6.34%
Branża motoryzacyjna	5.34%
Różne	4.93%
Ubezpieczenia	4.38%
Komponenty elektroniczne	3.90%
Telekomunikacja	3.70%
Przetwarzanie danych	3.39%
Usługi finansowe	3.11%
Przemysł lotniczy	2.84%
Transport (lotnictwo)	2.74%
Elektryczne i elektronika	2.45%
Żywność / gospodarstwo domowe	2.34%
Produkty leśne	1.97%
Komponenty przemysłowe	1.95%
Materiały budowlane	1.70%
Budownictwo (mieszaniowe)	1.69%
Wypoczynek / turystyka	1.53%
Materiały – stal	1.47%
Napoje i produkty tytoniowe	1.33%
Merchandising	1.30%
Branża maszynowa i inżynierska	0.75%
<b>Razem</b>	<b>97.34%</b>

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

## SANTANDER GO GLOBALNYCH AKCJE ESG

### Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2022 (c.d.)

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>					
<b>Akcje</b>					
<b>Finlandia</b>					
EUR	169,934.00	NESTE OYJ COMMON STOCK	9,361,097.52	7,504,252.72	1.36%
<b>Finlandia razem</b>			<b>9,361,097.52</b>	<b>7,504,252.72</b>	<b>1.36%</b>
<b>Niemcy</b>					
EUR	51,155.00	ALLIANZ SE COMMON STOCK	13,250,805.84	9,739,776.52	1.76%
EUR	88,685.00	DEUTSCHE BOERSE AG	15,249,579.14	14,797,430.84	2.68%
<b>Niemcy razem</b>			<b>28,500,384.98</b>	<b>24,537,207.36</b>	<b>4.44%</b>
<b>Irlandia</b>					
USD	39,969.00	ACCENTURE PLC COMMON	13,849,687.17	11,097,392.85	2.01%
USD	28,329.00	LINDE PLC COMMON STOCK	8,731,148.16	8,145,437.37	1.47%
USD	48,259.00	TRANE TECHNOLOGIES PLC	8,965,324.98	6,267,396.33	1.13%
<b>Irlandia razem</b>			<b>31,546,160.31</b>	<b>25,510,226.55</b>	<b>4.61%</b>
<b>Izrael</b>					
USD	78,910.00	CHECK POINT SOFTWARE	11,002,096.67	9,609,659.80	1.74%
<b>Izrael razem</b>			<b>11,002,096.67</b>	<b>9,609,659.80</b>	<b>1.74%</b>
<b>Japonia</b>					
JPY	122,900.00	SONY GROUP CORP COMMON	13,085,485.53	10,036,991.65	1.81%
<b>Japonia razem</b>			<b>13,085,485.53</b>	<b>10,036,991.65</b>	<b>1.81%</b>
<b>Holandia</b>					
EUR	25,904.00	KONINKLIJKE DSM NV	5,102,016.07	3,712,851.23	0.67%
EUR	222,618.00	SIGNIFY NV COMMON STOCK	12,329,818.19	7,361,439.21	1.33%
EUR	269,111.00	STMICROELECTRONICS NV	13,532,047.39	8,440,262.74	1.53%
<b>Holandia razem</b>			<b>30,963,881.65</b>	<b>19,514,553.18</b>	<b>3.53%</b>
<b>Wielka Brytania</b>					
GBP	252,104.00	ASTRAZENECA PLC COMMON	29,674,119.78	33,066,110.62	5.98%
GBP	484,254.00	GLAXOSMITHKLINE PLC	11,048,294.76	10,383,533.28	1.88%
GBP	522,146.00	RELX PLC COMMON STOCK	16,219,369.82	14,115,515.32	2.55%
<b>Wielka Brytania razem</b>			<b>56,941,784.36</b>	<b>57,565,159.22</b>	<b>10.41%</b>

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 2022 (c.d.)

#### Stany Zjednoczone

USD	66,332.00	ADVANCE MICRO DEVICES	6,401,081.05	5,072,408.04	0.92%
USD	100,308.00	AGCO CORP COMMON STOCK	13,002,344.41	9,900,399.60	1.79%
USD	11,976.00	ALPHABET INC COMMON	29,741,456.20	26,098,817.76	4.72%
USD	67,885.00	AMAZON.COM INC COMMON	11,252,947.17	7,210,065.85	1.30%
USD	37,684.00	ANTHEM INC COMMON STOCK	15,173,019.91	18,185,544.72	3.29%
USD	178,666.00	APPLE INC COMMON STOCK	25,602,078.01	24,427,215.52	4.42%
USD	24,263.00	ASPEN TECHNOLOGY INC	3,845,313.84	4,456,627.84	0.81%
USD	7,261.00	AUTOZONE INC COMMON	14,836,838.88	15,604,760.32	2.82%
USD	660,194.00	BANK OF AMERICA CORP	28,205,333.73	20,551,839.22	3.72%
USD	3,965.00	BOOKING HOLDINGS INC	9,630,828.54	6,934,745.35	1.25%
USD	89,369.00	CAPITAL ONE FINANCIAL	13,607,916.09	9,311,356.11	1.68%
USD	200,394.00	CBRE GROUP INC COMMON	18,867,118.11	14,751,002.34	2.67%
USD	191,137.00	CHENIERE ENERGY INC	21,414,941.65	25,426,955.11	4.60%
USD	175,231.00	COLGATE-PALMOLIVE CO	14,282,718.20	14,043,012.34	2.54%
USD	12,008.00	COSTCO WHOLESALE CORP	5,369,801.36	5,755,194.24	1.04%
USD	110,294.00	CROWN HOLDINGS INC	13,377,893.35	10,165,797.98	1.84%
USD	95,792.00	EBAY INC COMMON STOCK	6,239,442.08	3,991,652.64	0.72%
USD	48,317.00	ELECTRONIC ARTS INC	6,711,017.44	5,877,763.05	1.06%
USD	84,581.00	ELI LILLY & CO COMMON	19,520,306.96	27,423,697.63	4.96%
USD	19,569.00	HOME DEPOT INC/THE	5,662,755.26	5,367,189.63	0.97%
USD	72,589.00	MARSH & MCLENNAN COS INC	11,147,626.31	11,269,442.25	2.04%
USD	37,388.00	META PLATFORMS INC	13,065,395.11	6,028,815.00	1.09%
USD	140,046.00	MICROSOFT CORP COMMON	39,465,778.47	35,968,014.18	6.48%
USD	37,697.00	NVIDIA CORP COMMON STOCK	10,768,705.08	5,714,488.23	1.03%
USD	24,623.00	S&P GLOBAL INC COMMON	10,180,991.92	8,299,428.38	1.50%
USD	16,485.00	THERMO FISHER SCIENTIFIC	8,732,562.42	8,955,970.80	1.62%
USD	53,641.00	UNITEDHEALTH GROUP INC	22,939,397.85	27,551,626.83	4.98%
USD	94,608.00	VISA INC COMMON STOCK	20,779,770.77	18,627,369.12	3.37%
USD	14,735.00	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	6,318,706.08	4,331,353.25	0.78%
<b>Stany Zjednoczone razem</b>			<b><u>426,144,086.25</u></b>	<b><u>387,302,553.33</u></b>	<b><u>70.01%</u></b>
<b>Akcje ogółem</b>			<b><u>607,544,977.27</u></b>	<b><u>541,580,603.81</u></b>	<b><u>97.91%</u></b>
<b>Zbywalne papiery wartościowe dopuszczone do oficjalnego notowania na giełdzie lub znajdujące się w obrocie na innym rynku regulowanym - ogółem</b>			<b><u>607,544,977.27</u></b>	<b><u>541,580,603.81</u></b>	<b><u>97.91%</u></b>
<b>Inwestycje ogółem</b>			<b><u>607,544,977.27</u></b>	<b><u>541,580,603.81</u></b>	<b><u>97.91%</u></b>

**Klasyfikacja geograficzna inwestycji na dzień 30 czerwca 2022 r.**

	% WAN
Stany Zjednoczone	70.01%
Wielka Brytania	10.41%
Irlandia	4.61%
Niemcy	4.44%
Holandia	3.53%
Japonia	1.81%
Izrael	1.74%
Finlandia	1.36%
<b>Razem</b>	<b>97.91%</b>

**Ekonomiczna klasyfikacja inwestycji na dzień 30 czerwca 2022 r.**

	% WAN
Zdrowotne / osobiste	21.08%
Przetwarzanie danych	14.42%
Różne	9.42%
Elektryczne i elektronika	7.37%
Zróżna energia	5.95%
Usługi finansowe	5.86%
Merchandising	5.82%
Komponenty elektroniczne	4.26%
Ubezpieczenia	3.80%
Banowość	3.72%
Żywność / gospodarstwo domowe	3.58%
Materiały budowlane	2.97%
Nieruchomości	2.67%
Przemysł chemiczny	2.14%
Urządzenia	1.81%
Branża maszynowa i inżynierska	1.79%
Wypoczynek / turystyka	1.25%
<b>Total</b>	<b>97.91%</b>

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

## SANTANDER GO DYNAMIC BOND

### Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2022 (c.d.)

Opis	Waluta	Ilość	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>Obligacje</i>					
<i>AUSTRALIA</i>					
SANTOS 3.649% 04/31	USD	400,000.00	400,122.00	339,714.52	0.26%
SYDNEY 3.9% 03/23	USD	100,000.00	105,109.00	100,146.11	0.07%
TOTAL AUSTRALIA			505,231.00	439,860.63	0.33%
<i>AUSTRIA</i>					
ERSTE GROUP BANK AG VAR 12/64	EUR	200,000.00	258,541.19	203,988.20	0.15%
TOTAL AUSTRIA			258,541.19	203,988.20	0.15%
<i>BERMUDA</i>					
MARVELL 2.95% 04/31	USD	800,000.00	803,376.00	672,209.06	0.50%
TOTAL BERMUDA			803,376.00	672,209.06	0.50%
<i>BRAZIL</i>					
ITAU UNIBANCO 5.5% 08/22	USD	200,000.00	210,730.00	199,820.00	0.15%
TOTAL BRAZIL			210,730.00	199,820.00	0.15%
<i>CANADA</i>					
AIR CANADA 4.625% 08/29	CAD	100,000.00	79,579.82	66,063.65	0.05%
BROOKFIELD 4.7% 09/47	USD	200,000.00	227,960.99	175,609.30	0.13%
FAIRFAX 2.75% 03/28	EUR	150,000.00	179,864.50	145,038.35	0.11%
FAIRFAX 4.625% 04/30	USD	300,000.00	323,230.64	288,323.94	0.21%
TOTAL CANADA			810,635.95	675,035.24	0.50%
<i>CAYMAN ISLANDS</i>					
APIDOS CLO XV FLT 04/31	USD	1,100,000.00	1,100,781.00	1,080,631.20	0.81%
ATLAS SENIOR FLT 01/30	USD	1,097,676.00	1,097,895.14	1,082,797.71	0.81%
AVOLON 2.528% 11/27	USD	457,000.00	472,740.90	372,921.08	0.28%
KKR FINANCIAL FLT 04/29	USD	700,000.00	696,990.00	692,801.20	0.52%
SANDS CHINA 3.1% 03/29	USD	200,000.00	199,494.00	141,856.00	0.11%
SANDS CHINA 5.4% 08/28	USD	300,000.00	339,570.00	231,795.00	0.17%
WYNN MACAU 5.625% 08/28	USD	600,000.00	606,750.00	371,271.00	0.28%
TOTAL CAYMAN ISLANDS			4,514,221.04	3,974,073.19	2.98%
<i>FRANCE</i>					
ALTAREA SCA 1.875% 01/28	EUR	100,000.00	111,449.15	83,134.36	0.06%
ALTICE 4.25% 10/29	EUR	200,000.00	234,270.00	156,612.45	0.12%
ALTICE FRANCE 5.5% 10/29	USD	200,000.00	200,000.00	153,397.00	0.11%
ARGAN SA 1.011% 11/26	EUR	400,000.00	461,820.00	341,970.87	0.25%
BNP PARIBAS SA VAR 01/31	USD	400,000.00	416,884.00	345,398.63	0.26%
BNP PARIBAS SA VAR 09/28	USD	200,000.00	202,952.00	171,083.20	0.13%
BNP PARIBAS SA VAR 09/29	USD	400,000.00	400,000.00	335,008.09	0.25%
BPCE SA VAR 10/46	EUR	200,000.00	230,889.84	150,696.39	0.11%
HOLDING 0.125% 09/25	EUR	100,000.00	117,906.74	93,386.55	0.07%
HOLDING 0.625% 09/28	EUR	200,000.00	235,801.67	168,322.37	0.13%
MUTUELLE VAR 06/52	EUR	200,000.00	240,753.77	158,122.00	0.12%

**SANTANDER SICAV**

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

**SANTANDER GO DYNAMIC BOND****Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2022 (c.d.)***FRANCE (continued)*

SOCIETE GENERALE SA VAR 12/64	USD	500,000.00	551,900.00	481,719.04	0.36%
TOTAL FRANCE			3,404,627.17	2,638,850.95	1.97%

*GERMANY*

DEUTSCHE 1.625% 01/27	EUR	100,000.00	110,683.04	93,748.72	0.07%
DEUTSCHE 2.625% 12/24	GBP	100,000.00	129,960.89	115,573.86	0.09%
DEUTSCHE BANK 3.3% 11/22	USD	400,000.00	417,866.00	399,965.80	0.30%
DEUTSCHE BANK AG VAR 12/64	USD	200,000.00	200,056.00	173,500.00	0.13%
DEUTSCHE BANK VAR 01/32	USD	600,000.00	597,660.00	451,614.52	0.34%
DEUTSCHE BANK VAR 11/25	USD	150,000.00	150,000.00	145,086.60	0.11%
DEUTSCHE BANK VAR 11/26	USD	200,000.00	203,733.11	177,882.01	0.13%
FRAPORT AG 2.125% 07/27	EUR	100,000.00	123,447.26	95,468.61	0.07%
IHO 3.75% 09/26	EUR	200,000.00	248,401.97	173,925.45	0.13%
INEOS 2.25% 01/27	EUR	100,000.00	118,861.10	81,164.56	0.06%
VOLKSWAGEN 0.875% 02/25	GBP	100,000.00	136,502.74	111,539.31	0.08%
VOLKSWAGEN 1.875% 12/24	GBP	300,000.00	392,765.18	345,587.44	0.26%
ZF EUROPE 2% 02/26	EUR	300,000.00	358,014.51	260,307.64	0.19%
TOTAL GERMANY			3,187,951.60	2,625,364.52	1.96%

*HONG KONG*

MELCO 5.375% 12/29	USD	200,000.00	200,000.00	121,006.95	0.09%
TOTAL HONG KONG			200,000.00	121,006.95	0.09%

*IRELAND*

AERCAP 3.3% 01/32	USD	400,000.00	398,496.00	320,808.14	0.24%
AVOLON 3.95% 07/24	USD	100,000.00	104,499.00	95,818.21	0.07%
BLACK DIAMOND FLT 01/32	EUR	1,697,397.00	2,053,426.09	1,747,075.26	1.30%
CARLYLE GLOBAL FLT 07/30	EUR	599,599.00	658,414.91	615,018.23	0.46%
DRYDEN 51 EURO FLT 07/31	EUR	595,588.00	653,728.90	612,447.38	0.46%
EURO-GALAXY VI FLT 04/31	EUR	800,000.00	873,299.06	814,707.97	0.61%
OAK HILL FLT 01/32	EUR	499,631.00	594,879.65	511,903.58	0.38%
PERRIGO 4.4% 06/30	USD	200,000.00	214,130.00	178,756.20	0.13%
TOTAL IRELAND			5,550,863.61	4,896,334.97	3.65%

*ISLE OF MAN*

SASOL 4.5% 11/22	USD	200,000.00	206,400.00	199,120.00	0.15%
TOTAL ISLE OF MAN			206,400.00	199,120.00	0.15%

*ISRAEL*

ENERGEAN 4.875% 03/26	USD	300,000.00	300,000.00	265,890.00	0.20%
TOTAL ISRAEL			300,000.00	265,890.00	0.20%

*ITALY*

AMCO - ASSET 2.25% 07/27	EUR	100,000.00	113,685.00	100,153.20	0.07%
ATLANTIA 1.625% 02/25	EUR	400,000.00	486,590.16	382,379.61	0.29%
ATLANTIA 1.875% 02/28	EUR	600,000.00	719,556.87	489,912.92	0.37%
INTESA 5.148% 06/30	GBP	100,000.00	125,965.00	105,366.89	0.08%



## Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2022 (c.d.)

## ITALY (continued)

INTESA SANPAOLO SPA VAR 12/84	EUR	200,000.00	298,679.90	198,975.27	0.15%
UNICREDIT 7.83% 12/23	USD	400,000.00	471,100.00	414,367.38	0.31%
TOTAL ITALY			2,213,576.93	1,691,155.27	1.27%

## JAPAN

MIZUHO 2.564% 09/31	USD	500,000.00	500,000.00	399,488.94	0.30%
MIZUHO 3.477% 04/26	USD	200,000.00	210,460.00	192,473.59	0.14%
NISSAN 2.652% 03/28	EUR	100,000.00	130,859.85	97,681.71	0.07%
NISSAN 4.345% 09/27	USD	600,000.00	641,168.00	551,241.92	0.41%
NOMURA 3.103% 01/30	USD	900,000.00	952,513.00	766,397.27	0.57%
TOTAL JAPAN			2,435,000.85	2,007,283.43	1.49%

## JERSEY

ATRIUM 2.625% 09/27	EUR	200,000.00	238,526.18	169,251.03	0.13%
DORIC 5.125% 11/22	USD	14,559.00	14,522.37	14,432.83	0.01%
GLOBALWORTH 2.95% 07/26	EUR	100,000.00	113,256.65	84,142.41	0.06%
TP ICAP 2.625% 11/28	GBP	200,000.00	267,950.18	199,529.68	0.15%
TOTAL JERSEY			634,255.38	467,355.95	0.35%

## LUXEMBOURG

ADLER GROUP 2.25% 04/27	EUR	300,000.00	356,477.76	152,414.06	0.11%
ALTICE 3% 01/28	EUR	100,000.00	97,489.38	78,345.81	0.06%
AROWNTOWN 0.375% 04/27	EUR	600,000.00	663,350.39	489,932.58	0.37%
BEVCO LUX SARL 1% 01/30	EUR	600,000.00	723,760.20	495,571.68	0.37%
CBRE GLOBAL 0.9% 10/29	EUR	200,000.00	229,963.38	165,532.31	0.12%
CPI 1.625% 04/27	EUR	150,000.00	163,186.28	125,297.01	0.09%
CPI PROPERTY 1.75% 01/30	EUR	200,000.00	221,966.34	147,755.30	0.11%
CPI PROPERTY 2.75% 05/26	EUR	300,000.00	397,766.09	279,483.99	0.21%
CROMWELL 2.125% 11/25	EUR	400,000.00	498,341.63	341,952.24	0.25%
JAB HOLDINGS 2.2% 11/30	USD	500,000.00	498,940.00	394,873.23	0.29%
JAB HOLDINGS BV 1% 12/27	EUR	100,000.00	109,607.97	89,313.33	0.07%
LINCOLN 3.625% 04/24	EUR	100,000.00	113,800.62	101,471.38	0.08%
TOTAL LUXEMBOURG			4,074,650.04	2,861,942.92	2.13%

## SOUTH KOREA

HYUNDAI 0.75% 09/23	USD	200,000.00	199,738.00	192,545.32	0.14%
TOTAL SOUTH KOREA			199,738.00	192,545.32	0.14%

## SPAIN

BANCO 1.5% 04/26	GBP	300,000.00	416,656.44	327,523.85	0.24%
TOTAL SPAIN			416,656.44	327,523.85	0.24%

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

## SANTANDER GO DYNAMIC BOND

### Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2022 (c.d.)

<i>SUPRANATIONAL</i>					
DELTA AIR 4.5% 10/25	USD	100,000.00	100,000.00	97,261.10	0.07%
TOTAL SUPRANATIONAL			100,000.00	97,261.10	0.07%
<i>SWEDEN</i>					
BALDER FINLAND 1% 01/29	EUR	200,000.00	242,235.93	131,955.62	0.10%
SAGAX AB 2% 01/24	EUR	200,000.00	231,434.56	204,620.24	0.15%
SAGAX EURO 0.75% 01/28	EUR	100,000.00	120,683.18	80,336.56	0.06%
SAGAX EURO MTN 1% 05/29	EUR	300,000.00	360,525.51	231,434.23	0.17%
SAMHALLSBYGGN 1.75% 01/25	EUR	150,000.00	170,166.78	115,665.45	0.09%
TOTAL SWEDEN			1,125,045.96	764,012.10	0.57%
<i>SWITZERLAND</i>					
CREDIT SUISSE FLT 08/24	USD	300,000.00	305,443.15	300,490.57	0.22%
CREDIT SUISSE GROUP VAR 12/64	USD	1,300,000.00	1,422,875.00	1,152,428.62	0.86%
CREDIT SUISSE VAR 02/27	USD	250,000.00	250,000.00	215,134.00	0.16%
UBS 7.625% 08/22	USD	300,000.00	331,537.50	300,894.12	0.22%
UBS AG BOND 5.125% 05/24	USD	200,000.00	221,640.00	199,960.00	0.15%
TOTAL SWITZERLAND			2,531,495.65	2,168,907.31	1.61%
<i>THE NETHERLANDS</i>					
CTP NV 0.625% 09/26	EUR	200,000.00	234,326.47	167,244.80	0.12%
CTP NV 1.25% 08/29	EUR	200,000.00	239,179.63	146,156.15	0.11%
CTP NV 1.5% 09/31	EUR	200,000.00	233,076.58	126,496.60	0.09%
ING GROEP NV VAR 12/64	USD	500,000.00	513,025.00	419,350.30	0.31%
PROSUS NV 3.68% 01/30	USD	100,000.00	100,000.00	79,756.67	0.06%
STICHTING AK STEP 12/64	EUR	150,000.00	232,139.25	152,705.74	0.11%
ZIGGO BOND 3.375% 02/30	EUR	100,000.00	110,020.00	73,651.95	0.05%
ZIGGO BOND 5.125% 02/30	USD	300,000.00	305,625.00	235,704.28	0.18%
TOTAL THE NETHERLANDS			1,967,391.93	1,401,066.49	1.03%
<i>UNITED ARAB EMIRATES</i>					
DAE FUNDING 3.375% 03/28	USD	200,000.00	197,422.00	176,206.40	0.13%
TOTAL UNITED ARAB EMIRATES			197,422.00	176,206.40	0.13%
<i>UNITED KINGDOM</i>					
BARCLAYS 4.375% 01/26	USD	400,000.00	456,357.80	396,542.09	0.30%
BARCLAYS PLC VAR 11/32	USD	300,000.00	300,000.00	241,450.32	0.18%
BARCLAYS PLC VAR 12/64	GBP	400,000.00	577,250.24	467,485.51	0.35%
BCP V 4.75% 11/28	EUR	400,000.00	462,419.99	333,540.36	0.25%
BELLIS 3.25% 02/26	GBP	400,000.00	553,799.99	379,625.42	0.28%
GAZPROM PJSC 3% 08/27	USD	200,000.00	205,500.00	60,000.00	0.04%
GSK 3.125% 03/25	USD	400,000.00	398,956.00	390,049.98	0.29%
HSBC 4.95% 03/30	USD	200,000.00	199,750.00	197,781.61	0.15%
HSBC HOLDINGS PLC VAR 12/64	USD	300,000.00	300,000.00	226,352.54	0.17%
HSBC HOLDINGS VAR 05/30	USD	200,000.00	213,292.00	183,884.36	0.14%
HSBC HOLDINGS VAR 08/31	USD	600,000.00	636,932.00	507,495.95	0.38%
HSBC HOLDINGS VAR 08/31	USD	300,000.00	309,030.00	243,439.19	0.18%

## Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2022 (c.d.)

## UNITED KINGDOM (continued)

IMPERIAL 1.75% 03/33	EUR	400,000.00	472,484.46	304,625.48	0.23%
INEOS QUATTRO 2.5% 01/28	EUR	100,000.00	121,505.00	88,289.12	0.07%
INFORMA PLC 2.125% 10/25	EUR	200,000.00	255,695.86	202,992.03	0.15%
LENDLEASE 3.5% 12/33	GBP	200,000.00	264,744.46	190,221.26	0.14%
LLOYDS BANKING GROUP VAR 12/64	USD	100,000.00	107,500.00	94,215.50	0.07%
LLOYDS BANKING VAR 11/25	EUR	200,000.00	219,750.33	198,136.71	0.15%
MARKS & 3.75% 05/26	GBP	200,000.00	282,487.34	213,822.13	0.16%
NATIONWIDE 0.55% 01/24	USD	200,000.00	199,846.00	190,097.96	0.14%
NATIONWIDE 1% 01/23	GBP	100,000.00	130,096.29	120,241.72	0.09%
NATIONWIDE BUILDING VAR 12/64	GBP	25,000.00	52,502.10	43,474.65	0.03%
NATIONWIDE VAR 03/24	USD	300,000.00	319,098.00	299,297.23	0.22%
NATIONWIDE VAR 08/24	USD	200,000.00	217,780.00	200,306.15	0.15%
NATWEST GROUP VAR 03/25	USD	600,000.00	655,421.00	594,348.07	0.44%
NATWEST GROUP VAR 05/29	USD	200,000.00	223,640.00	194,016.11	0.14%
NATWEST GROUP VAR 06/24	USD	300,000.00	326,542.50	299,380.90	0.22%
SANTANDER UK VAR 11/28	USD	600,000.00	659,500.00	557,477.72	0.42%
STANDARD VAR 01/27	USD	200,000.00	200,000.00	176,612.41	0.13%
TESCO 0.375% 07/29	EUR	200,000.00	240,490.03	162,002.77	0.12%
VIRGIN MEDIA 4.25% 01/30	GBP	100,000.00	128,147.48	98,157.92	0.07%
VMED 02 UK 4.5% 07/31	GBP	400,000.00	556,680.00	385,183.69	0.29%
WORKSPACE 2.25% 03/28	GBP	200,000.00	279,358.29	200,405.73	0.15%
TOTAL UNITED KINGDOM			10,526,557.16	8,440,932.59	6.29%

## UNITED STATES OF AMERICA

AAMES MORTGAGE FLT 04/36	USD	368,552.00	354,288.78	344,763.62	0.26%
ABFC 2005-WMC1 FLT 06/35	USD	137,369.00	135,222.38	133,015.26	0.10%
ABFC 2006-OPT2 FLT 10/36	USD	84,760.00	78,138.15	78,868.84	0.06%
ACE SECURITIES FLT 05/34	USD	56,085.00	54,823.20	56,173.16	0.04%
AEGIS ASSET FLT 10/35	USD	500,000.00	491,875.00	479,978.90	0.36%
AES CORP/THE 2.45% 01/31	USD	600,000.00	578,286.00	483,163.88	0.36%
ALASKA 4.8% 08/27	USD	264,725.00	284,771.13	261,731.80	0.20%
ALTERNATIVE 5.5% 03/36	USD	54,053.00	34,022.92	27,393.57	0.02%
ALTERNATIVE 6.5% 06/36	USD	1,200,051.00	709,530.09	692,957.27	0.52%
ALTERNATIVE FLT 09/47	USD	696,934.00	668,254.91	638,225.55	0.48%
ALTERNATIVE FLT 10/46	USD	102,726.00	96,241.04	93,240.91	0.07%
AMERICAN 0.4% 02/27	EUR	300,000.00	346,405.57	270,226.94	0.20%
AMERICAN 3% 10/28	USD	149,358.00	148,669.71	135,716.78	0.10%
AMERICAN 3.15% 02/32	USD	267,472.00	265,465.78	237,215.09	0.18%
AMERICAN 3.35% 10/29	USD	78,351.00	72,964.46	72,166.15	0.05%
AMERICAN 3.375% 02/31	USD	200,000.00	206,451.88	171,354.72	0.13%
AMERICAN 3.6% 09/27	USD	71,579.00	68,894.48	66,435.24	0.05%
AMERICAN HOME FLT 10/46	USD	98,618.00	92,524.35	88,219.79	0.07%
AMERIQUEST FLT 01/36	USD	600,000.00	594,750.00	576,367.62	0.43%
AMERIQUEST FLT 07/35	USD	100,000.00	95,375.00	96,133.53	0.07%
AMERIQUEST FLT 09/34	USD	460,540.00	460,395.80	455,982.10	0.34%
AMERIQUEST FLT 11/35	USD	126,230.00	124,179.22	124,338.74	0.09%

## Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2022 (c.d.)

## UNITED STATES OF AMERICA (continued)

ANHEUSER-BUSCH 4.35% 06/40	USD	100,000.00	99,937.00	89,661.08	0.07%
ANHEUSER-BUSCH 3.5% 06/30	USD	100,000.00	99,790.00	93,833.71	0.07%
ARES FINANCE 3.25% 06/30	USD	100,000.00	99,771.00	88,759.91	0.07%
ARGENT FLT 11/34	USD	717,386.00	718,283.04	676,973.79	0.50%
ASSET BACKED FLT 02/35	USD	66,003.00	65,962.14	65,205.88	0.05%
ASSET BACKED FLT 07/35	USD	100,000.00	98,125.00	96,359.26	0.07%
AVIATION 4.125% 08/25	USD	100,000.00	108,384.00	95,150.47	0.07%
AVIATION 5.5% 12/24	USD	500,000.00	568,433.00	496,047.81	0.37%
BANK OF VAR 02/30	USD	100,000.00	109,161.00	94,577.87	0.07%
BANK OF VAR 03/32	USD	300,000.00	300,000.00	252,409.19	0.19%
BANK OF VAR 04/31	USD	200,000.00	212,460.00	169,800.36	0.13%
BANK OF VAR 04/32	USD	500,000.00	506,155.00	420,204.45	0.31%
BEAR STEARNS FLT 02/36	USD	449,866.00	446,491.96	448,836.25	0.33%
BEAR STEARNS FLT 02/37	USD	500,000.00	468,437.50	474,944.65	0.35%
BEAR STEARNS FLT 04/36	USD	88,852.00	85,115.10	86,346.17	0.06%
BEAR STEARNS FLT 07/34	USD	248,928.00	242,117.46	236,214.88	0.18%
BEAR STEARNS FLT 08/36	USD	173,380.00	170,961.73	172,466.75	0.13%
BEAR STEARNS FLT 10/35	USD	68,838.00	67,202.93	66,609.59	0.05%
BECTON 0% 08/23	EUR	200,000.00	235,076.76	205,525.71	0.15%
BECTON 0.034% 08/25	EUR	100,000.00	117,195.00	96,844.12	0.07%
BECTON 0.334% 08/28	EUR	400,000.00	468,780.00	350,038.28	0.26%
BLUE OWL 3.125% 06/31	USD	300,000.00	296,190.00	231,874.21	0.17%
BROADCOM INC 2.6% 02/33	USD	700,000.00	697,116.00	539,095.84	0.40%
BROADCOM INC 4.3% 11/32	USD	400,000.00	437,908.00	363,823.84	0.27%
CAESARS 6.25% 07/25	USD	800,000.00	841,625.00	773,692.00	0.58%
CARLYLE 3.5% 09/29	USD	150,000.00	149,500.50	136,104.94	0.10%
CCO HOLDINGS 4.5% 08/30	USD	300,000.00	315,937.50	250,044.94	0.19%
CCO HOLDINGS 5% 02/28	USD	100,000.00	105,437.50	92,615.50	0.07%
CHARTER 3.9% 06/52	USD	900,000.00	873,321.00	626,522.94	0.47%
CHARTER 4.908% 07/25	USD	100,000.00	114,925.43	100,367.74	0.07%
CIT MORTGAGE FLT 10/37	USD	100,000.00	101,062.50	93,634.53	0.07%
CITIGROUP FLT 05/35	USD	100,000.00	98,750.00	97,739.11	0.07%
CITIGROUP FLT 07/45	USD	682,161.00	591,774.46	518,320.06	0.39%
CITIGROUP FLT 12/35	USD	114,909.00	103,274.50	109,344.95	0.08%
COTY INC 5% 04/26	USD	300,000.00	308,407.50	275,401.50	0.21%
COTY INC/HFC 4.75% 01/29	USD	600,000.00	600,000.00	516,249.00	0.38%
CREDIT-BASED FLT 01/34	USD	152,473.00	148,518.31	143,625.77	0.11%
CROWN CASTLE 3.15% 07/23	USD	100,000.00	103,184.00	98,953.69	0.07%
CWABS FLT 02/36	USD	596,476.00	575,972.34	578,109.58	0.43%
CWABS FLT 05/36	USD	79,275.00	77,292.93	78,176.62	0.06%
CWABS FLT 06/35	USD	113,901.00	104,646.33	106,095.35	0.08%
CWABS FLT 08/35	USD	600,000.00	599,250.00	581,515.74	0.43%
CWABS FLT 11/35	USD	500,000.00	499,687.50	485,548.30	0.36%
CWABS FLT 11/47	USD	219,028.00	211,404.13	239,763.45	0.18%
DELTA AIR LINES 7% 05/25	USD	400,000.00	452,500.00	405,416.91	0.30%

## Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2022 (c.d.)

## UNITED STATES OF AMERICA (continued)

DEUTSCHE ALT-A FLT 12/36	USD	692,470.00	350,808.33	273,905.42	0.20%
DISCOVER 4.65% 08/28	USD	250,000.00	281,797.03	240,839.55	0.18%
DISH DBS 5.25% 12/26	USD	500,000.00	500,000.00	392,857.50	0.29%
EPR 4.5% 08/27	USD	50,000.00	53,959.50	45,301.27	0.03%
EQT CORP 6.625% 02/25	USD	100,000.00	100,000.00	103,073.50	0.08%
EXPEDIA 2.95% 03/31	USD	500,000.00	497,771.00	398,221.15	0.30%
EXPEDIA 6.25% 05/25	USD	176,000.00	198,722.24	181,484.69	0.14%
FAIR ISAAC CORP 4% 06/28	USD	100,000.00	100,000.00	88,768.50	0.07%
FIRST FRANKLIN FLT 01/35	USD	316,137.00	312,976.05	313,340.39	0.23%
FORD MOTOR 1.744% 07/24	EUR	100,000.00	108,485.00	96,825.61	0.07%
FORD MOTOR 2.33% 11/25	EUR	100,000.00	124,992.81	92,849.03	0.07%
FORD MOTOR 2.386% 02/26	EUR	100,000.00	124,992.81	91,692.13	0.07%
FORD MOTOR 2.7% 08/26	USD	500,000.00	500,000.00	426,700.00	0.32%
FORD MOTOR 3.25% 09/25	EUR	300,000.00	388,312.70	288,119.85	0.21%
FORD MOTOR 5.584% 03/24	USD	300,000.00	325,125.00	299,064.00	0.22%
FORD MOTOR FLT 12/24	EUR	100,000.00	113,700.67	97,572.58	0.07%
FREMONT HOME FLT 08/35	USD	1,013,000.00	990,848.75	930,570.27	0.69%
GOLDMAN 0.523% 03/23	USD	200,000.00	200,000.00	196,145.35	0.15%
GOLDMAN SACHS VAR 03/24	USD	200,000.00	200,000.00	195,464.52	0.15%
GOLDMAN SACHS VAR 03/27	USD	500,000.00	500,000.00	444,042.45	0.33%
GOLDMAN SACHS VAR 04/24	EUR	300,000.00	362,438.75	308,582.34	0.23%
GSAMP TRUST FLT 11/34	USD	93,744.00	90,580.25	91,419.21	0.07%
GSAMP TRUST FLT 11/35	USD	356,773.00	353,873.91	348,842.14	0.26%
GSAMP TRUST FLT 11/36	USD	219,569.00	119,116.15	116,641.38	0.09%
HILTON 3.625% 02/32	USD	200,000.00	200,000.00	159,334.00	0.12%
HOME EQUITY FLT 03/35	USD	700,000.00	694,750.00	689,543.47	0.51%
HOME EQUITY FLT 11/35	USD	700,000.00	695,187.50	663,918.78	0.49%
HSI ASSET FLT 04/37	USD	170,960.00	114,650.28	95,619.14	0.07%
HUDSON 3.25% 01/30	USD	150,000.00	149,577.00	130,729.07	0.10%
HYATT HOTELS 1.8% 10/24	USD	100,000.00	99,994.00	94,602.42	0.07%
HYATT HOTELS FLT 10/23	USD	100,000.00	100,000.00	99,834.48	0.07%
INDYMAC INDX FLT 02/37	USD	342,896.00	266,601.76	238,033.05	0.18%
INDYMAC INDX FLT 07/36	USD	287,667.00	282,838.36	272,957.12	0.20%
INDYMAC INDX VAR 08/35	USD	415,144.00	390,235.21	346,339.06	0.26%
JPMORGAN CHASE VAR 02/26	USD	500,000.00	500,000.00	475,814.61	0.35%
JPMORGAN CHASE VAR 05/30	USD	150,000.00	161,068.50	139,666.86	0.10%
LEHMAN XS TRUST FLT 03/37	USD	49,967.00	48,847.12	49,803.00	0.04%
LEHMAN XS TRUST FLT 12/36	USD	75,406.00	73,708.39	74,721.08	0.06%
LIVE NATION 6.5% 05/27	USD	100,000.00	100,000.00	98,551.00	0.07%
LONG BEACH FLT 09/34	USD	243,172.00	235,572.43	230,475.53	0.17%
LONG BEACH FLT 09/36	USD	413,184.00	308,855.03	277,388.99	0.21%
MAGALLANES 3.638% 03/25	USD	200,000.00	200,000.00	193,954.80	0.14%
MIDWEST 3.9% 04/24	USD	200,000.00	204,500.00	196,399.67	0.15%
MILEAGE PLUS 6.5% 06/27	USD	200,000.00	208,750.00	197,165.00	0.15%
MORGAN STANLEY FLT 01/35	USD	702,905.00	671,493.55	652,514.63	0.49%

## Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2022 (c.d.)

## UNITED STATES OF AMERICA (continued)

MORGAN STANLEY FLT 02/37	USD	488,461.00	282,320.32	276,525.84	0.20%
MORGAN STANLEY FLT 03/36	USD	138,042.00	117,680.93	115,095.07	0.09%
MORGAN STANLEY FLT 09/33	USD	124,446.00	121,179.75	121,808.85	0.09%
MORGAN STANLEY FLT 10/36	USD	559,707.00	330,227.23	284,940.26	0.21%
MORGAN STANLEY VAR 08/36	USD	398,883.00	137,365.47	91,322.67	0.07%
MPT 3.692% 06/28	GBP	150,000.00	193,848.62	158,092.05	0.12%
NATIONAL 2.95% 03/31	USD	400,000.00	389,544.00	325,038.86	0.24%
NEW CENTURY FLT 09/35	USD	700,000.00	700,000.00	684,343.24	0.51%
NEW CENTURY FLT 11/34	USD	592,381.00	580,842.03	563,227.84	0.42%
NEXTERA ENERGY FLT 03/23	USD	200,000.00	200,000.00	199,026.55	0.15%
NISSAN MOTOR 1.85% 09/26	USD	100,000.00	99,976.00	84,361.18	0.06%
NOVASTAR FLT 09/37	USD	102,296.00	99,187.34	100,823.79	0.08%
OMEGA 4.75% 01/28	USD	150,000.00	163,872.00	142,250.76	0.11%
ONEOK INC 6.35% 01/31	USD	100,000.00	99,667.00	104,575.32	0.08%
OPTION ONE FLT 02/35	USD	668,285.00	666,614.43	647,527.87	0.48%
OPTION ONE FLT 03/37	USD	555,969.00	514,966.53	507,786.85	0.38%
OPTION ONE FLT 04/37	USD	805,808.00	687,455.08	602,893.41	0.45%
OPTION ONE FLT 05/37	USD	247,159.00	184,287.88	166,570.39	0.12%
OPTION ONE FLT 12/35	USD	731,000.00	728,258.75	710,377.10	0.53%
ORGANON & 4.125% 04/28	USD	400,000.00	400,000.00	355,490.00	0.26%
OWNIT MORTGAGE FLT 09/37	USD	343,231.00	321,349.72	301,394.21	0.22%
PACIFIC GAS 3.25% 06/31	USD	400,000.00	399,152.00	323,487.59	0.24%
PACIFIC GAS 3.3% 08/40	USD	100,000.00	99,501.00	69,095.20	0.05%
PACIFIC GAS 3.75% 08/42	USD	100,000.00	103,500.00	67,853.02	0.05%
PACIFIC GAS 4.55% 07/30	USD	700,000.00	782,647.00	622,656.52	0.46%
PARK 4.875% 05/29	USD	400,000.00	400,000.00	344,120.00	0.26%
PENSKE 4.875% 07/22	USD	100,000.00	108,462.21	100,024.12	0.07%
PENSKE TRUCK 4.45% 01/26	USD	200,000.00	229,381.83	197,368.09	0.15%
RALI SERIES FLT 01/37	USD	107,042.00	98,810.78	92,218.79	0.07%
RALI SERIES VAR 09/37	USD	111,991.00	80,913.73	87,810.28	0.07%
RAMP SERIES FLT 05/37	USD	120,591.00	108,112.81	112,362.50	0.08%
RENAISSANCE STEP 11/36	USD	1,281,789.00	660,121.29	535,057.14	0.40%
SAXON ASSET FLT 03/35	USD	121,065.00	110,850.56	112,767.23	0.08%
SAXON ASSET FLT 11/37	USD	740,996.00	728,028.83	726,868.65	0.54%
SAXON ASSET FLT 12/34	USD	476,088.00	469,839.49	447,695.91	0.33%
SECURITIZED FLT 07/36	USD	113,218.00	97,933.72	100,427.70	0.07%
SECURITIZED FLT 10/35	USD	621,097.00	620,320.51	605,333.87	0.45%
SLM STUDENT FLT 04/23	USD	88,633.00	89,373.69	88,470.27	0.07%
SOUNDVIEW HOME FLT 03/36	USD	721,143.00	721,004.34	703,979.20	0.53%
SOUNDVIEW HOME FLT 03/37	USD	97,757.00	90,913.91	92,262.33	0.07%
SOUNDVIEW HOME FLT 07/37	USD	422,116.00	390,721.44	374,821.17	0.28%
SOUNDVIEW HOME FLT 10/36	USD	90,593.00	85,384.16	87,044.17	0.06%
SOUTHERN 3.7% 04/30	USD	100,000.00	99,751.00	92,888.30	0.07%
SOUTHERN 3.7% 08/25	USD	200,000.00	213,530.42	196,920.89	0.15%
SPECIALTY FLT 11/37	USD	620,635.00	429,789.85	394,751.39	0.29%

## Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2022 (c.d.)

## UNITED STATES OF AMERICA (continued)

SPIRIT 4.6% 06/28	USD	200,000.00	218,084.02	147,989.00	0.11%
STANDARD 2.25% 11/28	EUR	150,000.00	166,501.44	122,919.34	0.09%
STRUCTURED FLT 07/46	USD	108,120.00	90,233.61	93,097.22	0.07%
STRUCTURED FLT 09/36	USD	139,580.00	109,919.07	100,637.89	0.08%
SYNCHRONY 3.95% 12/27	USD	300,000.00	334,125.00	273,759.41	0.20%
SYNCHRONY 4.5% 07/25	USD	150,000.00	160,998.00	146,101.57	0.11%
SYSTEM 2.14% 12/25	USD	100,000.00	99,967.00	92,940.08	0.07%
TBA GNMA2 SINGLE 4% 07/52	USD	3,600,000.00	3,599,859.37	3,585,304.69	2.67%
TBA UMBS SINGLE 3.5% 08/52	USD	1,900,000.00	1,834,390.63	1,825,625.81	1.36%
TBA UMBS SINGLE FAMILY 3% 08/52	USD	3,400,000.00	3,123,085.94	3,164,125.00	2.36%
TD SYNEX 2.375% 08/28	USD	400,000.00	400,000.00	337,646.75	0.25%
TEGNA INC 4.625% 03/28	USD	100,000.00	100,000.00	93,774.50	0.07%
T-MOBILE USA 2.05% 02/28	USD	100,000.00	99,787.00	86,913.77	0.06%
T-MOBILE USA 2.25% 11/31	USD	200,000.00	197,365.71	162,514.57	0.12%
T-MOBILE USA 3.6% 11/60	USD	100,000.00	99,745.00	73,099.12	0.05%
UBER 4.5% 08/29	USD	200,000.00	198,750.00	164,875.00	0.12%
UNITED 4.625% 04/29	USD	300,000.00	300,000.00	255,508.50	0.19%
UNITED 5.875% 10/27	USD	423,421.00	461,528.70	416,773.34	0.31%
US FOODS 4.625% 08/30	USD	300,000.00	300,000.00	253,309.88	0.19%
VICI 4.625% 06/25	USD	200,000.00	214,500.00	190,591.00	0.14%
WABTEC 1.25% 12/27	EUR	300,000.00	363,361.89	256,891.81	0.19%
WAMU FLT 04/37	USD	1,252,805.00	609,567.84	531,497.43	0.40%
WAMU MORTGAGE FLT 05/46	USD	22,820.00	20,423.90	20,840.90	0.02%
WAMU MORTGAGE VAR 09/36	USD	509,980.00	509,322.22	468,431.26	0.35%
WELLS FARGO & VAR 04/31	USD	700,000.00	845,579.00	685,268.12	0.51%
WELLS FARGO FLT 04/37	USD	1,648,943.00	1,452,656.83	1,344,218.42	1.00%
WMG 2.25% 08/31	EUR	400,000.00	473,539.99	318,576.21	0.24%
WPC EURO BOND 1.35% 04/28	EUR	200,000.00	220,387.63	175,385.67	0.13%
TOTAL UNITED STATES OF AMERICA			63,094,538.42	57,750,575.44	43.01%

Obligacje razem 109,468,906.32 95,258,321.88 70.96%

## Obligacje skarbowe

## DOMINICAN REPUBLIC

DOMINICAN REPUBLIC 5.3% 01/41	USD	150,000.00	150,000.00	104,481.32	0.08%
TOTAL DOMINICAN REPUBLIC			150,000.00	104,481.32	0.08%

## ISRAEL

STATE OF ISRAEL 3.8% 05/60	USD	600,000.00	691,800.00	501,450.00	0.37%
TOTAL ISRAEL			691,800.00	501,450.00	0.37%

## JAPAN

JAPAN BILL ZERO 07/22	JPY	3,084,000,000.00	24,907,591.93	22,701,909.24	16.97%
TOTAL JAPAN			24,907,591.93	22,701,909.24	16.97%

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

## SANTANDER GO DYNAMIC BOND

### Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2022 (c.d.)

<b>PERU</b>					
REPUBLIC OF PERU 5.94% 02/29	PEN	200,000.00	64,550.91	48,106.62	0.04%
REPUBLIC OF PERU 6.35% 08/28	PEN	1,200,000.00	412,640.90	297,801.75	0.22%
REPUBLIC OF PERU 6.95% 08/31	PEN	4,900,000.00	1,707,465.00	1,225,979.16	0.91%
TOTAL PERU			<u>2,184,656.81</u>	<u>1,571,887.53</u>	<u>1.17%</u>
<b>QATAR</b>					
STATE OF QATAR 3.875% 04/23	USD	400,000.00	428,880.00	401,864.00	0.30%
TOTAL QATAR			<u>428,880.00</u>	<u>401,864.00</u>	<u>0.30%</u>
<b>ROMANIA</b>					
ROMANIA 1.75% 07/30	EUR	400,000.00	471,744.00	299,108.68	0.22%
TOTAL ROMANIA			<u>471,744.00</u>	<u>299,108.68</u>	<u>0.22%</u>
<b>SOUTH AFRICA</b>					
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 10.5% 12/26	ZAR	58,600,000.00	4,433,527.31	3,796,435.83	2.83%
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 4.85% 09/29	USD	400,000.00	412,680.00	342,688.00	0.26%
TOTAL SOUTH AFRICA			<u>4,846,207.31</u>	<u>4,139,123.83</u>	<u>3.09%</u>
<b>TURKEY</b>					
REPUBLIC OF TURKEY 6.35% 08/24	USD	250,000.00	261,750.00	231,740.00	0.17%
TOTAL TURKEY			<u>261,750.00</u>	<u>231,740.00</u>	<u>0.17%</u>
<b>UNITED STATES OF AMERICA</b>					
GOLDEN ST 2.587% 08/29	USD	400,000.00	400,000.00	355,708.00	0.27%
GOLDEN ST 2.746% 08/34	USD	200,000.00	200,000.00	172,864.00	0.13%
TOBACCO 3.401% 08/34	USD	100,000.00	100,000.00	84,907.00	0.06%
UNITED 0.125% 01/23	USD	800,000.00	794,690.48	788,741.45	0.59%
UNITED 0.125% 11/22	USD	3,700,000.00	3,684,401.55	3,666,110.55	2.73%
UNITED 0.375% 04/25	USD	300,000.00	300,468.75	278,466.80	0.21%
UNITED 0.375% 11/25	USD	1,700,000.00	1,622,197.29	1,553,109.38	1.16%
UNITED 1.875% 02/41	USD	5,600,000.00	4,318,898.81	4,394,359.37	3.28%
UNITED STATES 1.5% 10/24	USD	1,100,000.00	1,076,547.37	1,063,003.91	0.79%
UNITED STATES 2% 08/24	USD	4,500,000.00	4,405,725.50	4,415,800.77	3.29%
TOTAL UNITED STATES OF AMERICA			<u>16,902,929.75</u>	<u>16,773,071.23</u>	<u>12.51%</u>
Obligacje skarbowe razem			<u>50,845,559.80</u>	<u>46,724,635.83</u>	<u>34.88%</u>
Zbywalne papiery wartościowe dopuszczone do oficjalnego notowania na giełdzie lub znajdujące się w obrocie na innym rynku regulowanym			<u>160,314,466.12</u>	<u>141,982,957.71</u>	<u>105.84%</u>
<b>Fundusze inwestycyjne</b>					
<b>Irlandia</b>					
USD 33,025.00 PIMCO SELECT FUNDS PLC			328,812.95	328,535.86	0.24%
Irlandia razem			<u>328,812.95</u>	<u>328,535.86</u>	<u>0.24%</u>
Fundusze inwestycyjne razem			<u>328,812.95</u>	<u>328,535.86</u>	<u>0.24%</u>
Inwestycje ogółem			<u>160,643,279.07</u>	<u>142,311,493.57</u>	<u>106.08%</u>
Informacje dodatkowe stanowią integralną część niniejszych sprawozdań finansowych					



# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

---

## Klasyfikacja geograficzna inwestycji na dzień 30 czerwca 2022 r.

	% WAN
Stany Zjednoczone	55.55%
Japonia	18.42%
Wielka Brytania	6.29%
Irlandia	3.89%
RPA	3.09%
Kajmany	2.98%
Luksemburg	2.13%
Francja	1.97%
Niemcy	1.96%
Szwajcaria	1.62%
Włochy	1.26%
Peru	1.17%
Holandia	1.04%
Izrael	0.57%
Szwecja	0.57%
Bermudy	0.50%
Kanada	0.50%
Jersey	0.35%
Australia	0.33%
Katar	0.30%
Hiszpania	0.24%
Rumunia	0.22%
Turcja	0.17%
Austria	0.15%
Brazylia	0.15%
Wyspa Man	0.15%
Korea Południowa	0.14%
Zjednoczone Emiraty Arabskie	0.13%
Hongkong	0.09%
Republika Dominikany	0.08%
Ponadnarodowe	0.07%
<b>Razem</b>	<b>106.08%</b>

---

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

---

## Ekonomiczna klasyfikacja inwestycji na dzień 30 czerwca 2022 r.

	% WAN
Różne	19.52%
Kredyty hipoteczne	17.53%
Bony skarbowe	16.92%
Noty skarbowe	8.77%
Bankowość i finanse	8.32%
Oferty prywatne	8.04%
Dług państwowy	5.40%
Zabezpieczone zobowiązanie kredytowe (CLO)	5.33%
Listy zastawne UMBS TBA	3.72%
Obligacje skarbowe	3.28%
Listy zastawne GNMA II TBA	2.67%
Organizacje pozarządowe	2.63%
Narzędzia	1.80%
Leasing sprzętu	0.71%
Obligacje przychodowe	0.46%
Przemysłowe	0.44%
Inne	0.24%
Fundusze inwestycyjne otwarte	0.24%
Nie skarbowe	0.06%
<b>Razem</b>	<b>106.08%</b>

---

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

## SANTANDER FUTURE WEALTH

### Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2022 r.

Waluta	Ilość	Opis	Koszt USD	Wartość rynkowa USD	% WAN
<b>Fundusze inwestycyjne</b>					
<b>Francja</b>					
EUR	72,500.00	LYXOR NEW ENERGY DR TOTAL FRANCE	3,389,128.53	2,771,827.69	2.17%
<b>Francja razem</b>			<b>3,389,128.53</b>	<b>2,771,827.69</b>	<b>2.17%</b>
<b>Irlandia</b>					
USD	787,278.00	ISHARES DIGITALISATION	7,813,594.41	5,184,225.63	4.07%
USD	928,172.00	ISHARES ELECTRIC	7,078,802.45	5,574,601.03	4.37%
GBP	57,120.00	ISHARES GLOBAL TIMBER &	1,785,924.23	1,512,907.48	1.19%
USD	526,460.00	ISHARES S&P 500 HEALTH	5,129,680.52	5,130,352.70	4.03%
GBP	191,695.00	L&G CYBER SECURITY UCITS	4,904,525.31	3,585,175.74	2.81%
EUR	377,569.00	NEUBERGER BERMAN	5,585,095.70	4,053,873.28	3.18%
EUR	22,324.00	SPDR MSCI EUROPE HEALTH	4,758,143.95	4,393,729.64	3.45%
EUR	218,006.00	WELLINGTON FINTECH FUND	3,874,556.21	2,487,256.70	1.95%
<b>Irlandia razem</b>			<b>40,930,322.78</b>	<b>31,922,122.20</b>	<b>25.05%</b>
<b>Luksemburg</b>					
EUR	2,205.00	ALLIANZ GLOBAL	6,434,142.94	4,371,370.66	3.43%
USD	30,224.00	AXA WORLD FUNDS -	7,429,297.90	5,399,880.58	4.24%
USD	28,848.00	BELLEVUE FUNDS LUX -	5,799,005.71	4,712,342.04	3.70%
EUR	308,263.00	BNP PARIBAS EASY ECPI	5,194,508.64	4,451,242.27	3.49%
EUR	14,439.00	BNP PARIBAS FUNDS -	2,431,968.71	2,023,875.15	1.59%
EUR	14,152.00	BNP PARIBAS FUNDS - AQUA	5,293,324.78	4,251,783.10	3.34%
EUR	5,204.00	BNP PARIBAS FUNDS ENERGY	7,649,066.26	5,137,443.52	4.03%
EUR	32.00	CPR INVEST - GLOBAL	5,988,181.08	5,247,502.17	4.12%
EUR	15,566.00	DWS INVEST GLOBAL	2,655,910.09	2,430,769.48	1.91%
EUR	46,539.00	EDMOND DE ROTHSCHILD	5,815,763.60	5,033,733.47	3.95%
USD	220,447.00	GOLDMAN SACHS SICAV -	7,142,364.19	4,871,873.99	3.82%
USD	260,622.00	INVESCO ASIA CONSUMER	6,144,344.72	4,318,506.46	3.39%
EUR	56,216.00	JPMORGAN FUNDS -	7,314,593.30	4,083,408.18	3.20%
USD	7,982.00	LYXOR MSCI WORLD	4,506,916.49	3,670,363.06	2.88%
USD	52,355.00	MORGAN STANLEY	5,096,610.54	4,606,726.04	3.61%
USD	171,209.00	NINETY ONE GLOBAL	3,640,852.31	3,021,834.46	2.37%
EUR	70,295.00	NORDEA 1 SICAV - GLOBAL	2,709,844.85	2,265,681.77	1.78%
EUR	13,900.00	PICTET - SECURITY	5,969,154.94	4,556,484.17	3.58%
USD	19,097.00	PICTET-SMARTCITY	5,367,162.18	3,959,629.97	3.11%
USD	10,936.00	ROBECO CAPITAL GROWTH	2,039,384.41	1,670,732.99	1.31%
<b>Luksemburg razem</b>			<b>116,526,498.36</b>	<b>90,185,566.03</b>	<b>70.77%</b>
<b>Fundusze inwestycyjne ogółem</b>			<b>160,845,949.67</b>	<b>124,879,515.92</b>	<b>97.99%</b>
<b>Inwestycje ogółem</b>			<b>160,845,949.67</b>	<b>124,879,515.92</b>	<b>97.99%</b>

Informacje dodatkowe stanowią integralną część niniejszych sprawozdań finansowych

## SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

### Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2022 roku

#### SANTANDER FUTURE WEALTH

### Klasyfikacja geograficzna inwestycji na dzień 30 czerwca 2022 r.

	% WAN
Luksemburg	70.77%
Irlandia	25.05%
Francja	2.17%
<b>Razem</b>	<b>97.99%</b>

### Ekonomiczna klasyfikacja inwestycji na dzień 30 czerwca 2022 r.

	% WAN
Fundusze inwestycyjne otwarte	69.53%
ETF	28.46%
<b>Total</b>	<b>97.99%</b>

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

## Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2022 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 8 sierpnia 2022 roku, a zmiany zostały opublikowane w Elektronicznym rejestrze firm i stowarzyszeń (RESA) w dniu 23 sierpnia 2022 roku (RESA\_2021\_203).

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 rządowa 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 10 marca 2022 roku Rada Dyrektorów SICAV podjęła decyzję o uruchomieniu Subfunduszu SANTANDER GO GLOBAL HIGH YIELD BOND z datą wejścia w życie 4 kwietnia 2022 roku.

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 APH denominowane w GBP, 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, Klasa CD denominowane w USD, Klasa D denominowana w USD, Klasa 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.
-

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

## Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2022 roku

- 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. 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 są zarezerwowane dla podmiotów świadczących niezależne usługi doradcze lub usługi dyskrejonarnego 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. Żadna minimalna kwota subskrypcji nie ma zastosowania do tej klasy jednostek uczestnictwa. Stara się systematycznie przeliczać wartość swoich aktywów netto na BRL za pomocą instrumentów pochodnych, w tym transakcji terminowych typu forward bez dostawy. Ponieważ BRL jest

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

## Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2022 roku

walutą zastrzeżoną, Tytuły Uczestnictwa Klasy V nie mogą być denominowane w BRL, ale zamiast tego będą denominowane w Walucie Referencyjnej odpowiedniego Subfunduszu. Ze względu na wykorzystanie walutowych instrumentów pochodnych, wartość aktywów netto na akcję będzie zmieniać się zgodnie z wahaniami kursów wymiany pomiędzy BRL a Walutą Referencyjną Subfunduszu. Skutki tego zostaną odzwierciedlone w wynikach klasy jednostek uczestnictwa, które w związku z tym mogą znacznie różnić się od wyników innych klas jednostek uczestnictwa w ramach Subfunduszu. Wszelkie zyski lub straty, a także koszty i wydatki wynikające z tych transakcji będą odzwierciedlane wyłącznie w NAV tej klasy jednostek 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.

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 2022 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 (denominowana w EUR)
- \*Klasa I
- \*Klasa S

- 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 ME (denominowana w EUR) (utworzona 13 czerwca 2022 r.)
- \*Klasa RKP (denominowana w GBP)
- \*Klasa V

- 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 (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 SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

## Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2022 roku

- SANTANDER AM OBLIGACJI AMERYKI ŁACIŃSKIEJ (denominowany w USD)
    - \*Klasa A
    - \*Klasa AE (denominowana w EUR)
    - \*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 (denominowana w EUR)
    - \*Klasa B
    - \*Klasa I
    - \*Klasa IE (denominowana w EUR)
    - \*Klasa ME (denominowana w EUR)
    - \*Klasa RKP (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)
    - \*Klasa ID (utworzona 5 maja 2022 r.)
  
  - 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 SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

## Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2022 roku

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

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

## Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2022 roku

SANTANDER LATIN AMERICAN INVESTMENT GRADE ESG BOND (denominowany w USD)

\*Klasa A

\*Klasa I

SANTANDER FUTURE WEALTH (denominowany w USD)

\*Klasa A

\*Klasa AE (denominowana w EUR)

\*Klasa AEH (deminowana w EUR)

\*Klasa APH (deminowana w GBP)

\*Klasa M

\*Klasa RKP (deminowana w GBP)

\*Klasa V

\*Klasa X

\*Class XE (denominowana EUR)

SANTANDER GO GLOBAL HIGH YIELD BOND (denominowany w USD)(utworzony 4 kwietnia 2022 r.)

\*Klasa A

\*Klasa B

\*Klasa BEH (deminowana w EUR)

\*Klasa I

\*Klasa IEH (deminowana w EUR)

\*Klasa M

\*Klasa MEH (deminowana w EUR)

\*Klasa RKP (deminowana w GBP)

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 13 czerwca 2022 roku o wypłaceniu w dniu 29 czerwca 2022 roku zaliczki na poczet dywidendy w następującej wysokości:

- SANTANDER OBLIGACJI KORPORACYJNYCH AMERYKI ŁACIŃSKIEJ

\*Klasa AD: 2.344433 USD

- SANTANDER AM OBLIGACJI AMERYKI ŁACIŃSKIEJ

\*Klasa D: 1.284731USD

- SANTANDER KUPONU OBLIGACJI KORPORACYJNYCH

\*Klasa AD: 1.053693 USD

\*Klasa CD: 1.088888 USD

\*Klasa CDE: 1.258909 EUR

\*Klasa ID: 0.143328 USD

---

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

## Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2022 roku

### 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 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 zysk/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 2022 roku są równe łącznej sumie odpowiednich pozycji sprawozdań finansowych każdego z Subfunduszy, przeliczonych na EUR według kursu wymiany obowiązującego na dzień 30 czerwca 2022 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 2022 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 2022 roku:

1	EUR =	0. 859759	GBP
1	EUR =	1. 045450	USD

---

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

## Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2022 roku

### 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

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 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.

### 3.10 Koszty organizacyjne

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

---

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

## Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2022 roku

### 3.11 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.

### 3.12 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.

### 3.13 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 2022 roku

### 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 (jeśli konieczne) na rzecz pośrednika biorącego udział w dystrybucji tytułów uczestnictwa dla następujących Subfunduszy:

- SANTANDER GO KRÓTKOTERMINOWYCH PAPIERÓW WARTOŚCIOWYCH USD,
- SANTANDER OBLIGACJI KORPORACYJNYCH AMERYKI ŁACIŃSKIEJ,
- 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 GO ABSOLUTE RETURN,
- SANTANDER GO GLOBALNYCH AKCJI ESG,
- SANTANDER COVERED BOND,
- SANTANDER GO DYNAMIC BOND,
- SANTANDER LATIN AMERICAN INVESTMENT GRADE ESG BOND,
- SANTANDER FUTURE WEALTH,
- SANTANDER GO GLOBAL HIGH YIELD BOND (utworzony 4 kwietnia 2022 r.).

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

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 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 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,
- SANTANDER FUTURE WEALTH,
- SANTANDER GO GLOBAL HIGH YIELD BOND (utworzony 4 kwietnia 2022 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

## Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2022 roku

### 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
- 0.02% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy ME (utworzona 10 czerwca 2022 r.)
- 0.60% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy RKP
- 0.34% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy V

#### 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% 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 SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

## Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2022 roku

### SANTANDER AM EUROPEJSKICH OBLIGACJI KORPORACYJNYCH

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

- 1.55% 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
- 0.02% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy ME
- 0.70% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy RKP
- 1.75% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy A

### 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
- 0.40% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy ID (utworzona 5 maja 2022 r.)

### 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 i Klasy AUH

### SANTANDER MULTI INDEX SUBSTANCE

- 0.95% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy A

### SANTANDER MULTI INDEX BALANCE

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



# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

## Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2022 roku

### 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 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
- 0.40% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy M
- 0.60% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy RKP

### 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 IKP
- 0.45% za Tytuły Uczestnictwa Klasy M
- 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

- 1.05% za Tytuły Uczestnictwa Klasy A
- 0.50% za Tytuły Uczestnictwa Klasy I

### SANTANDER FUTURE WEALTH

- 1.35% za Tytuły Uczestnictwa Klasy A, Klasy AE i Klasy APH
  - 1.35% za Tytuły Uczestnictwa Klasy AEH
  - 0.03% za Tytuły Uczestnictwa Klasy M
  - 0.60% 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

## Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2022 roku

SANTANDER GO GLOBAL HIGH YIELD BOND (utworzony 4 kwietnia 2022 r.)

- 1.15% za Tytuły Uczestnictwa Klasy A
- 1.15% za Tytuły Uczestnictwa Klasy AE
- 0.50% za Tytuły Uczestnictwa Klasy I
- 0.50% za Tytuły Uczestnictwa Klasy IEH

### Nota 6 - Zobowiązania z tytułu podatków i inne koszty

	SANTANDER GO AKCJI PÓŁNOCNO AMERYKAŃSKICH	SANTANDER AM AKCJI EUROPEJSKICH
Koszty administracyjne (Nota 7)	154,066.35	110,711.48
Podatek roczny (Nota 8)	32,110.88	15,128.07
Koszty audytu i prawne	1,942.64	18,965.57
Opłaty na rzecz depozytariusza (Nota 7)	16,846.35	77,726.71
Opłaty za zarządzanie (Nota 5)	397,140.75	95,060.46
Inne opłaty	79,241.98	206,567.97
	<b>681,348.95</b>	<b>524,160.26</b>

  

	SANTANDER GO GLOBALNYCH AKCJI ESG	SANTANDER GO DYNAMIC BOND
Koszty administracyjne (Nota 7)	94,747.26	72,897.09
Podatek roczny (Nota 8)	37,831.65	9,420.48
Koszty audytu i prawne	2,555.19	1,957.38
Opłaty na rzecz depozytariusza (Nota 7)	4,209.86	141,943.15
Opłaty za zarządzanie (Nota 5)	380,558.73	106,520.14
Inne opłaty	23,081.77	36,722.14
	<b>542,984.46</b>	<b>369,460.38</b>

  

	SANTANDER FUTURE WEALTH
Koszty administracyjne (Nota 7)	51,269.99
Podatek roczny (Nota 8)	9,462.98
Koszty audytu i prawne	105.91
Opłaty na rzecz depozytariusza (Nota 7)	0.00
Opłaty za zarządzanie (Nota 5)	83,841.67
Inne opłaty	24,442.03
	<b>169,122.58</b>

### Nota nr 7 – Depozytariusz i koszty administracyjne

Jako Depozytariusz oraz Agent Administracyjny, Korporacyjny i Domicylacyjny J.P. MORGAN SE, Oddział w Luksemburgu<sup>3</sup> 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 (12 000 EUR) i usługi powiernicze (8.000 EUR) jest płacona przez SICAV dla J.P. MORGAN SE, Oddział w Luksemburgu jako wynagrodzenie za prowadzenie księgowości funduszu, wycenę i usługi powiernicze w przypadku gdy

<sup>3</sup> J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. połączył się z J.P. Morgan AG, który w tym samym dniu zmienił nazwę na J.P. Morgan SE, Oddział w Luksemburgu obowiązując od 22 stycznia 2022 r.

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

## Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2022 roku

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 Agenta 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 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 – Koszty transakcyjne

W okresie zakończonym 30 czerwca 2022 r. SICAV poniósł koszty transakcyjne, które zostały zdefiniowane jako opłaty maklerskie, związane z zakupem lub sprzedażą zbywalnych papierów wartościowych, instrumentów rynku pieniężnego, instrumentów pochodnych lub innych aktywów kwalifikowanych. SICAV poniósł również koszty transakcji ze strony Agenta Powiernika związane z zakupem i sprzedażą zbywalnych papierów wartościowych.

Koszty transakcji depozytowych są rejestrowane w Zestawieniu operacji i zmian w aktywach netto w pozycji „Inne wydatki” i są następujące:

		Opłaty maklerskie	Koszty transakcji depozytowych	Koszty transakcyjne razem
SANTANDER GO AKCJI PÓŁNOCNOAMERYKAŃSKICH	USD	-	-	-
SANTANDER AM AKCJI EUROPEJSKICH	EUR	77,719.75	5,883.29	83,603.04
SANTANDER GO GLOBALNYCH AKCJI ESG	USD	-	-	-
SANTANDER GO DYNAMIC BOND	USD	-	2,324.82	2,324.82
SANTANDER FUTURE WEALTH	USD	1,331.51	956.59	2,288.10

### Nota 11 – Terminowe kontrakty walutowe

Na dzień 30 czerwca 2022 roku, Subfundusz SANTANDER GO AKCJI PÓŁNOCNOAMERYKAŃSKICH miał zawarte następujące terminowe kontrakty walutowe:

	Kupiona ilość		Sprzedana ilość	Data zapadalności	Niezrealizowane USD	Druga strona kontraktu
BRL	112,950,004.00	USD	(21,655,770.85)	29/07/2022	(228,241.21)	JPMorgan Chase & Co.
BRL	14,631,774.00	USD	(2,762,067.05)	29/07/2022	13,698.87	JPMorgan Chase & Co.
EUR	28,764,112.00	USD	(30,273,764.40)	29/07/2022	(151,193.27)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	3,658,155.00	USD	(3,874,837.16)	29/07/2022	(43,916.57)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	10,000.00	USD	(10,617.02)	29/07/2022	(144.74)	JPMorgan Chase & Co.
USD	1,627,451.00	EUR	(1,540,448.78)	29/07/2022	14,250.10	JPMorgan Chase & Co.
USD	2,317,073.00	EUR	(2,198,892.42)	29/07/2022	14,332.19	JPMorgan Chase & Co.
USD	6,696.00	EUR	(6,379.03)	29/07/2022	15.71	JPMorgan Chase & Co.
USD	1,676,491.00	BRL	(8,823,371.72)	29/07/2022	2,625.91	JPMorgan Chase & Co.
				<b>Razem</b>	<b>(378,573.01)</b>	

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

## Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2022 roku

Na dzień 30 czerwca 2022 roku, Subfundusz SANTANDER GO GLOBALNYCH AKCJI ESG miał zawarte następujące terminowe kontrakty walutowe:

	Kupiona ilość		Sprzedana ilość	Data zapadalności	Niezrealizowane USD	Druga strona kontraktu
BRL	556,452,082.00	USD	(106,687,900.46)	29/07/2022	(1,124,438.17)	Banco Santander S.A.
EUR	30,870,094.00	USD	(32,490,277.41)	29/07/2022	(162,262.98)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	50,000.00	USD	(52,735.19)	29/07/2022	(373.81)	Captock
EUR	822,628.00	USD	(871,354.55)	29/07/2022	(9,875.74)	Captock
EUR	100,312.00	USD	(106,394.46)	29/07/2022	(1,344.65)	Captock
EUR	100.00	USD	(105.53)	29/07/2022	(0.81)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	835.00	USD	(879.16)	29/07/2022	(4.39)	Captock
EUR	23.00	USD	(24.61)	29/07/2022	(0.20)	JPMorgan Chase & Co.
USD	27,796.00	EUR	(26,378.74)	29/07/2022	171.94	JPMorgan Chase & Co.
			<b>Razem</b>		<b>(1,298,128.81)</b>	

Na dzień 30 czerwca 2022 roku, Subfundusz SANTANDER GO DYNAMIC BOND miał zawarte następujące terminowe kontrakty walutowe:

	Kupiona ilość		Sprzedana ilość	Data zapadalności	Niezrealizowane USD	Druga strona kontraktu
USD	92,607.00	PEN	(372,993.00)	25/07/2022	(5,294.82)	Bank of America
USD	952,038.00	PEN	(3,847,757.44)	26/07/2022	(57,792.24)	Bank of America
USD	330,539.00	ZAR	(5,291,169.15)	16/08/2022	9,046.35	BNP Paribas S.A.
USD	349,993.00	ZAR	(5,579,413.41)	16/08/2022	10,986.56	BNP Paribas S.A.
USD	346,338.00	ZAR	(5,556,993.21)	16/08/2022	8,693.81	BNP Paribas S.A.
USD	329,980.00	ZAR	(5,236,716.60)	16/08/2022	11,795.89	BNP Paribas S.A.
USD	362,295.00	ZAR	(5,846,625.30)	08/11/2022	10,047.50	BNP Paribas S.A.
USD	264,208.00	ZAR	(4,240,467.08)	08/11/2022	8,727.05	Barclays London
USD	66,249.00	PEN	(274,614.00)	29/11/2022	(4,993.69)	Standard Chartered Plc
AUD	878,000.00	USD	(618,890.61)	16/09/2022	(14,917.37)	Toronto Dominion Bank
BRL	10,092,675.00	USD	(2,031,414.25)	05/07/2022	(102,029.42)	Goldman Sachs Bank USA
BRL	10,092,675.00	USD	(1,936,207.54)	02/09/2022	(24,038.42)	Toronto Dominion Bank
BRL	1,054,719.00	USD	(201,647.90)	05/07/2022	(20.54)	BNP Paribas S.A.
BRL	1,009,245.00	USD	(191,052.99)	05/07/2022	1,881.23	UBS AG
BRL	10,092,675.00	USD	(1,926,818.52)	05/07/2022	2,566.31	Toronto Dominion Bank
CAD	369,000.00	USD	(289,580.29)	16/09/2022	(3,513.56)	Australia & New Zealand Banking
CAD	316,000.00	USD	(243,821.33)	16/09/2022	1,157.23	Royal Bank Of Canada, Toronto
CLP	533,696,266.00	USD	(641,103.09)	21/09/2022	(80,663.13)	Standard Chartered Plc
COP	754,100,000.00	USD	(196,313.75)	23/09/2022	(16,715.03)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	1,431,000.00	USD	(1,499,901.79)	16/09/2022	790.95	BNP Paribas S.A.
EUR	130,000.00	USD	(136,858.54)	16/09/2022	(527.26)	Royal Bank Of Canada, Toronto
EUR	507,000.00	USD	(548,138.89)	16/09/2022	(16,446.91)	Barclays London
EUR	360,000.00	USD	(388,344.56)	16/09/2022	(10,811.79)	BNP Paribas S.A.
EUR	482,000.00	USD	(512,393.86)	16/09/2022	(6,919.43)	JP Morgan Securities Plc
EUR	1,401,000.00	USD	(1,461,878.91)	16/09/2022	7,352.77	BNP Paribas S.A.
EUR	106,000.00	USD	(112,013.93)	16/09/2022	(851.50)	Standard Chartered Bank London
EUR	104,000.00	USD	(110,048.97)	16/09/2022	(983.95)	MS (FX OPS) London
EUR	389,000.00	USD	(412,649.45)	16/09/2022	(4,704.32)	MS (FX OPS) London
EUR	2,692,000.00	USD	(2,839,836.56)	16/09/2022	(16,730.43)	UBS AG
EUR	1,574,121.00	USD	(1,649,442.65)	05/07/2022	(3,675.60)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	435,000.00	USD	(454,648.30)	16/09/2022	1,537.13	BNP Paribas S.A.
EUR	23,418,165.00	USD	(24,647,241.92)	29/07/2022	(123,093.28)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	357,207.00	USD	(377,381.46)	29/07/2022	(3,304.38)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	2,018,480.00	USD	(2,124,417.40)	29/07/2022	(10,609.77)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	32,928,073.00	USD	(34,656,267.14)	29/07/2022	(173,080.37)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	50,000.00	USD	(52,824.01)	29/07/2022	(462.54)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	310,000.00	USD	(326,523.85)	29/07/2022	(1,883.19)	JPMorgan Chase & Co.
GBP	174,000.00	USD	(212,577.35)	16/09/2022	(1,091.03)	JP Morgan Securities Plc
GBP	1,601,000.00	USD	(1,949,587.17)	16/09/2022	(3,669.94)	Bank of America
JPY	214,597,577.00	USD	(1,642,640.00)	16/09/2022	(58,513.52)	JP Morgan Securities Plc
JPY	45,200,000.00	USD	(350,999.45)	16/09/2022	(17,339.97)	Barclays London
MXN	10,820,000.00	USD	(517,272.70)	01/07/2022	19,014.67	BNP Paribas S.A.
MXN	10,820,000.00	USD	(530,458.33)	15/09/2022	(1,578.07)	BNP Paribas S.A.
PEN	1,236,616.00	USD	(327,103.73)	14/07/2022	(2,118.00)	Bank of America
PEN	163,524.00	USD	(43,000.00)	08/09/2022	(142.16)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
PEN	155,854.00	USD	(41,000.00)	08/09/2022	(152.42)	Goldman Sachs Bank USA

**SANTANDER SICAV**

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

**Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2022 roku**

USD	1,123,732.00	PEN	(4,274,338.90)	08/08/2022	3,476.57	JPMorgan Chase & Co.
USD	8,898,594.00	JPY	(1,084,000,000.00)	11/07/2022	916,484.32	Barclays London
USD	41,182.00	MXN	(836,000.00)	09/08/2022	28.44	Bank of America
USD	16,213,371.00	JPY	(2,000,000,000.00)	19/07/2022	1,478,686.55	Standard Chartered Bank London
USD	54,675.00	MXN	(1,125,000.00)	08/09/2022	(386.95)	Royal Bank Of Canada, Toronto
USD	206,730.00	NZD	(322,000.00)	16/08/2022	6,611.77	UBS AG
USD	65,672.00	EUR	(62,000.00)	16/08/2022	652.57	BNP Paribas S.A.
USD	9,970,894.00	EUR	(9,423,585.00)	16/08/2022	88,359.98	MS (FX OPS) London
USD	2,213,235.00	GBP	(1,797,225.00)	16/08/2022	28,818.11	Bank of America
USD	241,133.00	CAD	(312,014.29)	16/08/2022	(755.64)	Royal Bank Of Canada, Toronto
USD	122,893.00	ZAR	(2,053,738.66)	12/05/2023	1,492.92	Goldman Sachs Bank USA
USD	138,524.00	ZAR	(2,262,983.47)	14/11/2022	2,266.67	UBS AG
USD	21,164.00	COP	(89,953,980.00)	16/11/2022	64.61	Standard Chartered Plc
USD	70,155.00	ZAR	(1,162,206.65)	13/02/2023	814.54	Bank of America
USD	615,788.00	CLP	(538,352,866.00)	18/08/2022	46,817.63	UBS AG
USD	17,317,421.00	EUR	(16,539,415.00)	16/08/2022	(27,498.89)	Bank of America
USD	2,803,372.00	GBP	(2,246,000.00)	16/08/2022	73,496.72	Toronto Dominion Bank
USD	141,686.00	EUR	(132,000.00)	16/08/2022	3,257.35	Royal Bank Of Canada, Toronto
USD	263,169.00	GBP	(208,000.00)	16/08/2022	10,358.19	Standard Chartered Bank London
USD	105,164.00	EUR	(98,000.00)	16/08/2022	2,391.21	BNP Paribas S.A.
USD	679,260.00	MXN	(13,535,000.00)	09/09/2022	16,805.55	UBS AG
USD	103,409.00	CAD	(130,000.00)	16/08/2022	2,627.01	Royal Bank Of Canada, Toronto
USD	106,363.00	CAD	(134,000.00)	16/08/2022	2,479.35	BNP Paribas S.A.
USD	427,950.00	ZAR	(6,616,021.41)	12/09/2022	27,084.76	Standard Chartered Bank London
USD	342,788.00	ZAR	(5,259,567.68)	13/07/2022	22,034.79	Bank of America
USD	20,855.00	ZAR	(326,486.33)	13/07/2022	944.76	BNP Paribas S.A.
USD	101,955.00	CAD	(131,000.00)	16/08/2022	396.96	BNP Paribas S.A.
USD	234,773.00	EUR	(224,000.00)	16/08/2022	(136.54)	BNP Paribas S.A.
USD	30,554.00	NZD	(49,000.00)	16/08/2022	101.00	JP Morgan Securities Plc
USD	54,319.00	NZD	(87,000.00)	16/08/2022	249.92	BNP Paribas S.A.
USD	126,789.00	CAD	(164,000.00)	16/08/2022	(352.06)	BNP Paribas S.A.
USD	1,951,595.00	BRL	(10,092,675.40)	05/07/2022	22,210.53	Toronto Dominion Bank
USD	538,387.00	MXN	(10,820,000.00)	01/07/2022	2,099.60	BNP Paribas S.A.
USD	201,000.00	BRL	(1,054,719.36)	05/07/2022	(627.36)	Goldman Sachs Bank USA
USD	132,314.00	ZAR	(2,105,000.00)	22/07/2022	4,066.41	BNP Paribas S.A.
USD	236,767.00	JPY	(31,900,000.00)	16/08/2022	1,286.23	Bank of America
USD	193,000.00	BRL	(1,009,245.25)	05/07/2022	65.78	Goldman Sachs Bank USA
USD	200,051.00	BRL	(1,054,719.36)	02/08/2022	222.58	BNP Paribas S.A.
USD	74,120.00	AUD	(107,000.00)	16/08/2022	514.97	Standard Chartered Bank London
USD	225,754.00	JPY	(30,600,000.00)	16/08/2022	(130.62)	Bank of America
USD	100,394.00	GBP	(82,000.00)	16/08/2022	728.24	MS (FX OPS) London
USD	189,521.00	BRL	(1,009,245.25)	02/08/2022	(1,691.36)	UBS AG
USD	122,072.00	ZAR	(1,961,000.00)	22/07/2022	2,597.66	UBS AG
USD	71,653.00	AUD	(103,000.00)	16/08/2022	799.53	Standard Chartered Bank London
USD	1,532,782.00	BRL	(8,028,710.79)	05/07/2022	(2,041.50)	Goldman Sachs Bank USA
USD	201,359.00	BRL	(1,054,719.36)	05/07/2022	(268.18)	BNP Paribas S.A.
USD	192,678.00	BRL	(1,009,245.25)	05/07/2022	(256.62)	UBS AG
USD	96,811.00	EUR	(91,184.61)	29/07/2022	1,319.84	JPMorgan Chase & Co.
USD	1,651,933.00	EUR	(1,574,120.96)	29/07/2022	3,470.02	JPMorgan Chase & Co.
USD	85,201.00	EUR	(80,246.20)	29/07/2022	1,164.51	JPMorgan Chase & Co.
ZAR	3,077,000.00	USD	(191,344.49)	22/07/2022	(3,877.53)	Bank of America
<b>Total</b>					<b>2,064,252.30</b>	

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

## Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2022 roku

Na dzień 30 czerwca 2022 roku, Subfundusz SANTANDER FUTURE WEALTH miał zawarte następujące terminowe kontrakty walutowe:

	Kupiona ilość		Sprzedana ilość	Data zapadalności	Niezrealizowane USD	Druga strona kontraktu
BRL	78,159,920.00	USD	(14,985,509.10)	29/07/2022	(157,939.92)	JPMorgan Chase & Co.
BRL	2,046,572.00	USD	(388,513.42)	29/07/2022	(262.12)	JPMorgan Chase & Co.
BRL	2,088,088.00	USD	(394,172.28)	29/07/2022	1,954.95	JPMorgan Chase & Co.
BRL	1,610,509.00	USD	(306,000.00)	29/07/2022	(473.49)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	3,368.00	USD	(3,544.44)	29/07/2022	(17.70)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	170.00	USD	(179.56)	29/07/2022	(2.03)	JPMorgan Chase & Co.
GBP	53,465.00	USD	(65,327.40)	29/07/2022	(368.19)	JPMorgan Chase & Co.
GBP	2,704.00	USD	(3,316.55)	29/07/2022	(31.31)	JPMorgan Chase & Co.
GBP	3,500.00	USD	(4,271.27)	29/07/2022	(18.83)	JPMorgan Chase & Co.
				<b>Razem</b>	<b>(157,158.64)</b>	

### Nota 12 - Kontrakty futures

Na dzień 30 czerwca 2022 roku, Subfundusz SANTANDER AM EURO EQUITY miał zawarte następujące kontrakty futures:

Waluta	Ilość kontraktów kupiona/ (sprzedana) Opis	Data zapadalności	Wartość rynkowa EUR	Niezrealizowane EUR	Druga strona kontraktu
EUR	(148.00) EURO STOXX 50 EQUITY INDEX	16/09/2022	(5,092,680.00)	25,160.00	BOFA Securities Europe S.A.
			<b>Razem</b>	<b>25,160.00</b>	

Na dzień 30 czerwca 2022 roku, Subfundusz SANTANDER GO DYNAMIC BOND miał zawarte następujące kontrakty futures:

Waluta	Ilość kontraktów kupiona/ (sprzedana) Opis	Data zapadalności	Wartość rynkowa	Niezrealizowana USD	Druga strona kontraktu
EUR	(58.00) EURO-BOBL	08/09/2022	(7,203,020.00)	(94,613.23)	Banco Santander S.A.
EUR	38.00 EURO-BTP	08/09/2022	4,678,560.00	(109,834.98)	Banco Santander S.A.
EUR	(23.00) EURO-BUND	08/09/2022	(3,421,940.00)	97,739.12	Morgan Stanley Frankfurt
GBP	(3.00) LONG GILT FUTURE BOND	28/09/2022	(341,940.00)	14,937.74	Banco Santander S.A.
USD	114.00 US 10YR NOTE (CBT) BOND	21/09/2022	13,512,562.50	(86,390.68)	Banco Santander S.A.
USD	(202.00) US 10YR ULTRA FUTURE	21/09/2022	(25,729,750.00)	(496,148.50)	Banco Santander S.A.
USD	207.00 US 5YR NOTE (CBT) BOND	30/09/2022	23,235,750.00	(74,390.63)	Banco Santander S.A.
USD	(1.00) US LONG CBT BOND	21/09/2022	(138,625.00)	726.64	
USD	(64.00) US ULTRA CBT BOND	21/09/2022	(9,878,000.00)	103,000.58	
			<b>Razem</b>	<b>(644,973.94)</b>	

Na dzień 30 czerwca 2022 roku, Subfundusz SANTANDER FUTURE WEALTH miał zawarte następujące kontrakty futures:

Waluta	Ilość kontraktów kupiona/ (sprzedana) Opis	Data zapadalności	Wartość rynkowa USD	Niezrealizowane USD	Druga strona kontraktu
USD	23.00 S&P500 EMINI EQUITY INDEX	16/09/2022	4,357,925.00	(126,787.50)	UBS Europe SE
			<b>Razem</b>	<b>(126,787.50)</b>	

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

## Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2022 roku

### Nota 13 – Kontrakty na opcje

Na dzień 30 czerwca 2022 roku, Subfundusz SANTANDER GO AKCJI PÓŁNOCNOAMERYKAŃSKICH miał zawarte kontrakty na opcje:

Waluta	Opis	Kupno/ sprzedaż	Cena wykonania	Data zapadalności	Ilość kupiona	Wartość rynkowa USD	Druga strona kontraktu
USD	FOREIGN EXCHANGE OPTION	Kupno	7.28	22/07/2022	430,799,832.43	20.01	Banco Santander S.A.
USD	FOREIGN EXCHANGE OPTION	Kupno	7.38	27/07/2022	124,910,732.61	2.17	Banco Santander S.A.
USD	FOREIGN EXCHANGE OPTION	Kupno	7.31	05/08/2022	197,966,609.91	356.98	Banco Santander S.A.
USD	FOREIGN EXCHANGE OPTION	Kupno	7.27	10/11/2022	444,870,768.31	429,728.78	Banco Santander S.A.
<b>Razem</b>						<b>430,107.94</b>	

Na dzień 30 czerwca 2022 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	Sprzedaż	2.10	15/09/2023	1,000,000.00	173,416.32	Morgan Stanley Capital Services
USD	SWAPTION	Sprzedaż	2.28	29/06/2023	1,300,000.00	187,874.34	JP Morgan (Germany)
USD	SWAPTION	Sprzedaż	2.06	25/10/2023	1,600,000.00	289,033.65	JP Morgan (Germany)
<b>Razem</b>						<b>650,324.31</b>	

Waluta	Opis	Kupno/ sprzedaż	Cena wykonania	Data zapadalności	Ilość sprzedana	Zaangażowanie	Wartość rynkowa USD	Druga strona kontraktu
BOND OPTION	USD	CALL	07/09/2022	1.01	(500,000.00)	505,703.00	(2,080.49)	JP Morgan (Germany)
BOND OPTION	USD	PUT	07/09/2022	2.98	(2,500,000.00)	22,346,475.00	(18,274.98)	JP Morgan (Germany)
CREDIT DEFAULT SWAP INDEX OPTION	EUR	PUT	20/07/2022	0.02	(2,400,000.00)	120,435.84	(5,379.97)	JP Morgan (Germany)
CREDIT DEFAULT SWAP INDEX OPTION	EUR	PUT	17/08/2022	0.15	(2,600,000.00)	1,255,794.52	(15,292.86)	JP Morgan (Germany)
CREDIT DEFAULT SWAP INDEX OPTION	USD	CALL	17/08/2022	0.01	(1,200,000.00)	8,400.00	(18.84)	JP Morgan (Germany)
CREDIT DEFAULT SWAP INDEX OPTION	USD	PUT	20/07/2022	0.01	(1,200,000.00)	14,400.00	(827.04)	JP Morgan (Germany)
CREDIT DEFAULT SWAP INDEX OPTION	USD	PUT	17/08/2022	0.98	(3,600,000.00)	10,546,200.00	(10,373.27)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION	EUR	CALL	28/04/2023	0.70	(600,000.00)	439,088.99	(461.71)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION	EUR	CALL	31/03/2023	0.55	(10,200,000.00)	5,864,974.43	(5,800.40)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION	EUR	CALL	26/04/2023	0.70	(600,000.00)	439,088.99	(464.14)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION	EUR	PUT	28/04/2023	2.25	(600,000.00)	1,411,357.48	(2,052.12)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION	EUR	PUT	07/02/2023	0.50	(34,900,000.00)	18,243,102.27	(450,783.18)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION	EUR	PUT	31/03/2023	2.10	(10,200,000.00)	22,393,538.72	(37,252.21)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION	EUR	PUT	26/04/2023	2.25	(600,000.00)	1,411,357.48	(2,040.55)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION	USD	CALL	20/10/2023	3.02	(300,000.00)	905,250.00	(2,132.50)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION	USD	CALL	23/10/2023	9.56	(900,000.00)	25,798,500.00	(7,272.61)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION	USD	CALL	02/11/2022	0.87	(27,300,000.00)	23,751,000.00	(220.16)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION	USD	CALL	25/10/2023	2.97	(300,000.00)	891,900.00	(2,078.47)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION	USD	CALL	27/10/2023	2.84	(300,000.00)	852,300.00	(1,876.33)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION	USD	PUT	20/10/2023	12.57	(1,200,000.00)	60,348,000.00	(5,935.76)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION	USD	PUT	15/09/2023	1.96	(5,000,000.00)	9,800,000.00	(269,485.03)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION	USD	PUT	02/11/2022	1.27	(27,300,000.00)	34,671,000.00	(625,708.44)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION	USD	PUT	29/06/2023	2.11	(6,400,000.00)	13,504,000.00	(310,484.82)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION	USD	PUT	25/10/2023	4.97	(8,300,000.00)	82,551,800.00	(422,857.48)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION	USD	PUT	27/10/2023	2.84	(300,000.00)	852,300.00	(1,847.60)	JP Morgan (Germany)
<b>Razem</b>						<b>(17,266,290.68)</b>		

# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

## Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2022 roku

### Nota 14 – Kontrakty swap ryzyka kredytowego

Na dzień 30 czerwca 2022 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
500,000.00	USVS	CDI	SELL	1.000%	12/25	(67,206.27)	(67,206.27)	JP Morgan (Germany)
600,000.00	USVS	CDI	SELL	1.000%	12/25	(80,647.53)	(80,647.53)	JP Morgan (Germany)
600,000.00	USVS	CDI	SELL	1.000%	12/25	(80,647.53)	(80,647.53)	JP Morgan (Germany)
400,000.00	USVS	CDI	SELL	1.000%	12/26	(51,909.90)	(51,909.90)	JP Morgan (Germany)
700,000.00	USVS	CDI	SELL	1.000%	12/26	(90,842.32)	(90,842.32)	JP Morgan (Germany)
400,000.00	USVS	CDI	SELL	1.000%	12/26	(51,909.90)	(51,909.90)	JP Morgan (Germany)
300,000.00	USVS	CDI	SELL	1.000%	12/26	(38,932.42)	(38,932.42)	JP Morgan (Germany)
200,000.00	USVS	CDI	SELL	1.000%	12/26	(25,954.95)	(25,954.95)	JP Morgan (Germany)
100,000.00	USVS	CDI	SELL	1.000%	12/26	(12,977.47)	(12,977.47)	JP Morgan (Germany)
100,000.00	USVS	CDI	SELL	1.000%	12/26	(12,977.47)	(12,977.47)	JP Morgan (Germany)
100,000.00	USVS	CDI	SELL	1.000%	12/26	(12,977.47)	(12,977.47)	JP Morgan (Germany)
1,000.00	USVS	CDI	SELL	5.000%	06/27	(27.10)	(27.10)	Credit Suisse Group AG
1,000.00	USVS	CDI	SELL	5.000%	06/27	(27.10)	(27.10)	Credit Suisse Group AG
9,000.00	USVS	CDI	SELL	5.000%	06/27	(243.89)	(243.89)	Credit Suisse Group AG
100,000.00	USD	CDS	SELL	1.000%	12/24	(2,033.96)	(2,033.96)	JP Morgan (Germany)
200,000.00	USD	CDS	SELL	1.000%	12/24	(6,238.25)	(6,238.25)	JP Morgan (Germany)
200,000.00	USD	CDS	SELL	1.000%	12/24	(4,511.15)	(4,511.15)	JP Morgan (Germany)
200,000.00	USD	CDS	SELL	1.000%	12/25	(10,619.51)	(10,619.51)	JP Morgan (Germany)
300,000.00	USD	CDS	SELL	1.000%	12/25	(12,401.65)	(12,401.65)	JP Morgan (Germany)
200,000.00	USD	CDS	SELL	1.000%	12/25	(8,593.01)	(8,593.01)	JP Morgan (Germany)
200,000.00	USVS	CDS	SELL	1.000%	06/26	(960.73)	(960.73)	JP Morgan (Germany)
300,000.00	USVS	CDS	SELL	1.000%	06/26	(1,441.09)	(1,441.09)	JP Morgan (Germany)
200,000.00	USVS	CDS	SELL	5.000%	12/25	21,203.52	21,203.52	JP Morgan (Germany)
300,000.00	USVS	CDS	SELL	5.000%	12/25	31,805.27	31,805.27	JP Morgan (Germany)
600,000.00	USVS	CDS	SELL	5.000%	12/25	58,711.31	58,711.31	JP Morgan (Germany)
100,000.00	USVS	CDS	SELL	5.000%	12/25	10,601.76	10,601.76	JP Morgan (Germany)
200,000.00	EUVS	CDS	SELL	1.000%	06/28	(7,040.47)	(7,040.47)	JP Morgan (Germany)
100,000.00	EUVS	CDS	SELL	1.000%	06/28	(3,520.23)	(3,520.23)	JP Morgan (Germany)
300,000.00	EUVS	CDS	SELL	1.000%	06/28	(10,560.70)	(10,560.70)	JP Morgan (Germany)
400,000.00	EUVS	CDS	SELL	5.000%	06/26	48,366.44	48,366.44	JP Morgan (Germany)
200,000.00	EUVS	CDS	SELL	1.000%	06/26	(13,617.98)	(13,617.98)	JP Morgan (Germany)
200,000.00	EUVS	CDS	SELL	1.000%	06/26	(13,617.98)	(13,617.98)	JP Morgan (Germany)
200,000.00	EUR	CDS	SELL	5.000%	12/26	19,872.02	19,872.02	JP Morgan (Germany)
100,000.00	EUR	CDS	SELL	5.000%	12/26	9,936.01	9,936.01	JP Morgan (Germany)
300,000.00	USD	CDS	SELL	1.000%	06/27	(10,007.11)	(10,007.11)	JP Morgan (Germany)
Razem						(431,948.81)	(431,948.81)	

### Nota 15 – Kontrakty swap stóp procentowych

Na dzień 31 czerwca 2022 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
-------	--------------------------------	------	-------------------------------	----------------------------------	---	------------------------



# SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

## Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2022 roku

6,400,000.00	CADS	06/26	IRS	BA	1.000%	(463,873.36)	JP Morgan (Germany)
100,000.00	CADS	03/25	IRS	BA	1.220%	(4,574.18)	JP Morgan (Germany)
300,000.00	CADS	03/25	IRS	BA	1.235%	(13,629.21)	JP Morgan (Germany)
100,000.00	CADS	03/25	IRS	BA	1.275%	(4,451.67)	JP Morgan (Germany)
100,000.00	CADS	03/25	IRS	BA	1.276%	(4,449.44)	JP Morgan (Germany)
4,100,000.00	CADS	11/23	IRS	BA	2.000%	(53,256.39)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
10,300,000.00	CADS	10/23	IRS	BA	2.060%	(129,310.51)	Royal Bank of Canada
11,400,000.00	NZVS	11/23	IRS	BBR	3.000%	(85,342.34)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
15,900,000.00	NZVS	12/23	IRS	BBR	3.000%	(124,880.44)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
700,000.00	USVS	06/26	IRS	LIBO	0.500%	(67,081.56)	JP Morgan (Germany)
800,000.00	USVS	03/25	IRS	LIBO	0.612%	(52,584.98)	JP Morgan (Germany)
2,200,000.00	USVS	03/25	IRS	LIBO	0.622%	(144,408.29)	JP Morgan (Germany)
1,380,000.00	USVS	03/31	IRS	LIBO	0.750%	243,932.58	JP Morgan (Germany)
29,870,000.00	MXVS	03/23	IRS	TIIE	5.660%	(40,098.82)	JP Morgan (Germany)
300,000.00	EUVS	04/27	IRS	EURI	0.700%	(14,680.80)	BNP Paribas S.A.
600,000.00	EUVS	04/27	IRS	EURI	0.650%	(30,892.01)	Clearer
500,000.00	EUVS	05/27	IRS	EURI	0.650%	(26,844.81)	Barclays Plc
700,000.00	EUVS	05/27	IRS	EURI	1.000%	(25,221.86)	Goldman Sachs International
11,175,800,000.00	KRVS	12/26	NDIRS	CD K/1	1.750%	(635,938.50)	JP Morgan (Germany)
5,707,500,000.00	KRVS	12/31	NDIRS	CD K/1	1.750%	583,946.94	JP Morgan (Germany)
6,436,900,000.00	KRVS	12/26	NDIRS	CD K/2	2.000%	(313,250.08)	JP Morgan (Germany)
3,383,600,000.00	KRVS	12/31	NDIRS	CD K/2	2.000%	290,439.20	JP Morgan (Germany)
494,900,000.00	THB	12/26	NDIRS	THBF/1	1.000%	978,515.93	JP Morgan (Germany)
255,800,000.00	THB	12/31	NDIRS	THBF/1	1.500%	(833,115.15)	JP Morgan (Germany)
1,163,396.02	BRVS	01/27	OIS	CDI	10.200%	(23,058.75)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
13,411,194.54	BRVS	01/27	OIS	CDI	11.040%	(166,759.56)	Clearer
5,300,000.00	GBVS	02/23	OIS	SONIA	0.500%	(70,178.44)	Goldman Sachs International
1,079,735.63	BRVS	01/27	OIS	CDI	11.080%	(13,254.50)	Clearer
5,098,315.16	BRVS	01/27	OIS	CDI	11.090%	(62,071.86)	Clearer
5,200,000.00	GBVS	09/27	OIS	SONIA	0.500%	602,961.92	Credit Suisse Group AG
3,800,000.00	GBVS	09/32	OIS	SONIA	0.750%	(667,253.47)	Credit Suisse Group AG
2,100,000.00	GBVS	09/52	OIS	SONIA	0.750%	806,233.51	Credit Suisse Group AG
3,900,000.00	USVS	05/32	OIS	SOFR	1.852%	(315,929.17)	Morgan Stanley
3,892,730.06	BRVS	01/27	OIS	CDI	11.81%	(22,806.00)	Clearer
1,500,000.00	USVS	12/52	OIS	SOFR	1.750%	263,304.39	Credit Suisse Group AG
300,000.00	GBVS	11/34	RPI	UKRPI	3.345%	(58,159.24)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
						<b>Razem (698,020.92)</b>	

### Nota 17 – wartość inwestycji pomiędzy Subfunduszami

Na dzień 30 czerwca 2022 roku ogólna wartość inwestycji pomiędzy Subfunduszami wyniosła 449,759.73 EUR w związku z tym ogólne skonsolidowane aktywa netto na koniec bez ww. pozycji wyniosły 5,123,604,605.16 EUR.

### Nota 18 – Istotne zdarzenia

Zarządzający dokonywał od końca lutego regularnej oceny sytuacji SICAV w kontekście rosyjskiej inwazji na Ukrainę i późniejszych międzynarodowych sankcji nałożonych na Rosję i rosyjskich obywateli oraz potwierdził, że SICAV od początku marca 2022 r. utrzymuje bardzo ograniczoną ekspozycję na Rosję i Ukrainę.

Biorąc to pod uwagę, Zarządzający potwierdza, że nie planuje rozwiązania SICAV ani na dzień wydania opinii audytorów, ani w dającej się przewidzieć przyszłości. Zarządzający będzie nadal ściśle monitorował sytuację SICAV w najlepszym interesie akcjonariuszy.

## **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 2022 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. Dotyczy subfunduszy SANTANDER SELECT INCOME oraz SANTANDER GO ABSOLUTE RETURN.

---