

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

(Société d'Investissement à Capital Variable)

Nierewidowany raport półroczny za okres od 1 stycznia 2023 do 30 czerwca 2023 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 2023 roku

Zestawienie aktywów netto na dzień 30 czerwca 2023 roku

Skonsolidowane zestawienie operacji i zmian w aktywach netto funduszu za okres kończący się 30 czerwca 2023 roku

Zestawienie operacji i zmian w aktywach netto funduszu za okres kończący się 30 czerwca 2023 roku

Dane statystyczne

SANTANDER GO SHORT DURATION DOLLAR

SANTANDER LATIN AMERICAN CORPORATE BOND

SANTANDER GO NORTH AMERICAN EQUITY

SANTANDER EUROPEAN DIVIDEND

SANTANDER AM LATIN AMERICAN FIXED INCOME

SANTANDER AM EURO CORPORATE BOND

SANTANDER AM EURO EQUITY

SANTANDER AM LATIN AMERICAN EQUITY OPPORTUNITIES

SANTANDER ACTIVE PORTFOLIO 1

SANTANDER ACTIVE PORTFOLIO 2

SANTANDER CORPORATE COUPON

SANTANDER SELECT DEFENSIVE

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 GLOBAL EQUITY ESG

SANTANDER COVERED BOND

SANTANDER GO DYNAMIC BOND

SANTANDER LATIN AMERICAN INVESTMENT GRADE ESG BOND

SANTANDER FUTURE WEALTH

SANTANDER GO GLOBALHIGH YIELD BOND

SANTANDER TARGET MATURITY 2026 EURO

SANTANDER TARGET MATURITY 2026 DOLLAR

SANTANDER GO ASIAN EQUITY

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2023 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 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
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.
43, Avenue John F. Kennedy
L-1855 Luksemburg
Wielkie Księstwo Luksemburga

Podmioty Zarządzające Aktywami

SANTANDER ASSET MANAGEMENT S.A., S.G.I.I.C
24, Paseo de la Castellana
28006 Madryt
Hiszpania

Dla następujących subfunduszy:

- SANTANDER ACTIVE PORTFOLIO 1
 - SANTANDER ACTIVE PORTFOLIO 2
 - SANTANDER AM EURO EQUITY
 - SANTANDER CORPORATE COUPON
 - SANTANDER EUROPEAN DIVIDEND
 - SANTANDER AM EURO CORPORATE BOND
 - SANTANDER AM LATIN AMERICAN FIXED INCOME
 - SANTANDER COVERED BOND
 - SANTANDER FUTURE WEALTH
 - SANTANDER SELECT INCOME
 - SANTANDER SELECT DEFENSIVE
-

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Dyrektorzy i administracja (c.d.)

- SANTANDER SELECT MODERATE
- SANTANDER SELECT DYNAMIC
- SANTANDER AM LATIN AMERICAN EQUITY OPPORTUNITIES
- SANTANDER TARGET MATURITY 2026 EURO
- SANTANDER TARGET MATURITY 2026 DOLLAR

SANTANDER ASSET MANAGEMENT UK LIMITED
287, St. Vincent Street
G2 5NB Glasgow, Szkocja
Wielka Brytania

Dla następujących subfunduszy:

- SANTANDER LATIN AMERICAN CORPORATE BOND
- SANTANDER MULTI INDEX BALANCE
- SANTANDER MULTI INDEX SUBSTANCE
- SANTANDER MULTI INDEX AMBITION
- SANTANDER LATIN AMERICAN INVESTMENT GRADE ESG BOND

AMUNDI SGR S.p.A.
Via Cernaia 8/10
20121 Mediolan
Włochy

Dla subfunduszu:

- SANTANDER GO ABSOLUTE RETURN

BLUEBAY ASSET MANAGEMENT LLP (do 31 marca 2023 r.)
RBC GLOBAL ASSET MANAGEMENT (UK) LIMITED (od 1 kwietnia
2023 r.)
77, 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 GLOBAL EQUITY ESG

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

Dla subfunduszu:

- SANTANDER GO SHORT DURATION DOLLAR
-

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Dyrektorzy i administracja (c.d.)

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

Dla subfunduszu:

- SANTANDER GO NORTH AMERICAN EQUITY

PIMCO DEUTSCHLAND GmbH
Seidlstrasse 24-24a
80335 Monachium
Niemcy

Dla subfunduszu:

- SANTANDER GO DYNAMIC BOND

SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT (HONG KONG) LIMITED
Level 33, Two Pacific Place,
88 Queensway
Hong Kong

Dla subfunduszu:

- SANTANDER GO ASIAN EQUITY

Pełnomocnicy

ALLFUNDS BANK S.A.U
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 oraz na stronie internetowej: www.santanderassetmanagement.lu.

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 2023 roku

	Noty	EUR
AKTYWA		
Inwestycje w papiery wartościowe po cenie rynkowej	3.1	4,259,992,535
Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 14	4,431,464
Opcje kupione po cenie rynkowej	3.6, 13	17,796,925
Swapy total return po cenie rynkowej	3.13, 16	1,328,339
Środki pieniężne w banku	3.1	163,286,233
Środki pieniężne u brokera	3.1	61,246,767
Należności z tytułu sprzedaży papierów wartościowych		45,261,940
Należności z subskrypcji		3,194,018
Należności z tytułu odsetek i dywidend	3.12	17,730,196
Rozliczenia międzyokresowe kosztów	3.13	268,644
Należność z tytułu umów z otrzymanym przyrzeczeniem odkupu	3.10, 17	12,087,912
Niezrealizowany zysk na kontraktach walutowych forward	3.4, 11	2,332,135
Niezrealizowany zysk na kontraktach futures	3.5, 12	3,725,303
Niezrealizowany zysk na kontraktach swap na stopy procentowe	3.7, 15	15,090,660
Inne należności		2,969,876
Aktywa ogółem		4,610,742,947
PASYWA		
Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 14	5,370,855
Wartość rynkowa opcji	3.6, 13	13,583,654
Swapy total return po cenie rynkowej	3.9, 16	1,573,877
Kredyt w rachunku bankowym	3.1	13,665
Kredyt w rachunku brokera	3.1	139,697
Zobowiązania z tytułu odsetek i dywidend netto	3.12	38,810
Kwoty płatne z tytułu nabytych papierów wartościowych		67,199,879
Zobowiązania z tytułu umorzeń		7,396,946
Zobowiązania z tytułu podatków i inne koszty	6	6,889,591
Niezrealizowana strata z kontraktów walutowych	3.4, 11	4,193,190
Niezrealizowana strata z kontraktów futures	3.5, 12	3,545,622
Niezrealizowana strata z kontraktów swap stóp proc.	3.7, 15	26,093,183
Inne wymagalne płatności		175,229
Pasywa ogółem		136,214,198
Aktywa netto razem		4,474,528,749

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie aktywów netto na dzień 30 czerwca 2023 roku (c.d.)

SANTANDER GO
NORTH AMERICAN
EQUITY
USD

Noty

AKTYWA

Inwestycje w papiery wartościowe po cenie rynkowej	3.1	644,590,046
Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 14	-
Opcje kupione po cenie rynkowej	3.6, 13	2,018,230
Swapy total return po cenie rynkowej	3.9, 16	-
Środki pieniężne w banku	3.1	15,047,311
Środki pieniężne u brokera	3.1	-
Należności z tytułu sprzedaży papierów wartościowych		-
Należności z subskrypcji		1,075,021
Należności z tytułu odsetek i dywidend netto	3.12	-
Rozliczenia międzyokresowe kosztów	3.13	24,346
Należność z tytułu umów z otrzymanym przyrzeczeniem odkupu	3.10, 17	-
Niezrealizowany zysk na kontraktach walutowych forward	3.4, 11	15,459
Niezrealizowany zysk na kontraktach futures	3.5, 12	-
Niezrealizowany zysk na kontraktach swapów procentowych	3.7, 15	-
Inne należności		2,662

Aktywa ogółem

662,773,075

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	-	-
Należne odsetki i dywidendy	3.12	-	-
Zobowiązania z tytułu nabycia pap. wartościowych		830,393	
Zobowiązania z tytułu umorzeń		363,945	
Zobowiązania z tytułu podatków i inne koszty	6	739,369	
Niezrealizowana strata z kontraktów walutowych	3.4, 11	550,398	
Niezrealizowana strata z kontraktów futures	3.5, 12	-	
Niezrealizowana strata z kontraktów swap stóp procentowych	3.7, 15	-	
Inne wymagane płatności		24	

Pasywa ogółem

2,484,129

Aktywa netto razem

660,288,946

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie aktywów netto na dzień 30 czerwca 2023 roku (c.d.)

		SANTANDER AM EURO EQUITY
	Noty	EUR
AKTYWA		
Inwestycje w papiery wartościowe po cenie rynkowej	3.1	447,363,612
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	12,217,245
Środki pieniężne u brokera	3.1	6,554,264
Należności z tytułu sprzedaży papierów wartościowych		-
Należności z subskrypcji		19,076
Należności z tytułu odsetek i dywidend netto	3.12	116,704
Rozliczenia międzyokresowe kosztów	3.13	6,245
Należność z tytułu umów z otrzymanym przyrzeczeniem odkupu	3.10, 17	-
Niezrealizowany zysk z tytułu terminowych transakcji walutowych umowy	3.4, 11	-
Niezrealizowany zysk na kontraktach futures	3.5, 12	-
Niezrealizowany zysk z kontraktów swap stóp procentowych	3.7, 15	-
Inne należności		1,567,751
Aktywa ogółem		467,844,897
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	-
Zobowiązania z tytułu odsetek i dywidend	3.12	-
Zobowiązania z tytułu nabycia papierów wartościowych		-
Zobowiązania z tytułu umorzeń		31,278
Zobowiązania z tytułu podatków i inne koszty	6	519,075
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		-
Pasywa ogółem		550,353
Aktywa netto razem		467,294,544

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie aktywów netto na dzień 30 czerwca 2023 roku (c.d.)

SANTANDER GO
GLOBAL EQUITY
ESG
USD

Noty

AKTYWA

Inwestycje w papiery wartościowe po cenie rynkowej	3.1	541,491,314
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	18,097,495
Środki pieniężne u brokera	3.1	-
Należności z tytułu sprzedaży papierów wartościowych		6,037,231
Należności z subskrypcji		926,119
Należności z tytułu odsetek i dywidend	3.12	55,142
Rozliczenia międzyokresowe kosztów	3.13	4,269
Należność z tytułu umów z otrzymanym przyrzeczeniem odkupu	3.10, 17	-
Niezrealizowany zysk na kontraktach walutowych forward	3.11	28,296
Niezrealizowany zysk na kontraktach futures	3.5, 12	-
Niezrealizowany zysk z kontraktów swap stóp procentowych	3.7, 15	-
Inne należności		368,698

Aktywa ogółem

567,008,564

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	-
Zobowiązania z tytułu odsetek i dywidend	3.12	-
Zobowiązania z tytułu nabycia papierów wartościowych		5,547,926
Zobowiązania z tytułu umorzeń		1,162,254
Zobowiązania z tytułu podatków i inne koszty	6	710,640
Niezrealizowana strata z kontraktów walutowych	3.4, 11	1,112,674
Niezrealizowana strata z kontraktów futures	3.5, 12	-
Niezrealizowana strata z kontraktów swap stóp procentowych	3.7, 15	-
Inne wymagane płatności		1,461

Pasywa ogółem

8,534,955

Aktywa netto razem

558,473,609

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie aktywów netto na dzień 30 czerwca 2023 roku (c.d.)

	Noty	SANTANDER GO DYNAMIC BOND USD
AKTYWA		
Inwestycje w papiery wartościowe po cenie rynkowej	3.1	128,470,351
Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 14	176,064
Opcje kupione po cenie rynkowej	3.6, 13	660,630
Swapy total return po cenie rynkowej	3.9, 16	-
Środki pieniężne w banku	3.1	3,630,419
Środki pieniężne u brokera	3.1	4,648,845
Należności z tytułu sprzedaży papierów wartościowych		30,313,658
Należności z subskrypcji		99,704
Należności z tytułu odsetek i dywidend netto	3.12	650,427
Wydatki opłacone z góry	3.13	23,981
Należność z tytułu umów z otrzymanym przyrzeczeniem odkupu	3.10, 17	13,200,000
Niezrealizowany zysk netto z kontraktów term. forward	3.4, 11	
Niezrealizowany zysk z kontraktów futures	3.7, 12	565,331
Niezrealizowany zysk z kontraktów swap stóp procentowych	3.7, 15	572,727
Inne należności		2,325,102
		709
Aktywa ogółem		185,337,948
PASYWA		
Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 14	53,622
Wartość rynkowa opcji	3.6, 13	1,234,302
Swapy total return po cenie rynkowej	3.9, 16	-
Kredyt w rachunku bankowym	3.1	-
Kredyt w rachunku brokera	3.1	147,369
Zobowiązania z tytułu odsetek i dywidend	3.12	8,426
Zobowiązania z tytułu nabycia papierów wartościowych		52,043,652
Zobowiązania z tytułu umorzeń		242,293
Zobowiązania z tytułu podatków i inne koszty	6	277,700
Niezrealizowana strata z kontraktów walutowych	3.4, 11	1,030,135
Niezrealizowana strata z kontraktów futures	3.5, 12	277,438
Niezrealizowana strata z kontraktów swap stóp proc.	3.7, 15	4,464,944
Inne wymagane płatności		1,052
Pasywa ogółem		39,836,152.02
Aktywa netto razem		134,160,921.86

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie aktywów netto na dzień 30 czerwca 2023 roku (c.d.)

SANTANDER
FUTURE WEALTH

USD

Noty

AKTYWA

Inwestycje w papiery wartościowe po cenie rynkowej	3.1	94,671,861
Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 14	-
Opcje kupione po cenie rynkowej	3.6, 13	25,245
Swapy total return po cenie rynkowej	3.9, 16	-
Środki pieniężne w banku	3.1	1,627,762
Środki pieniężne u brokera	3.1	1,878,087
Należności z tytułu sprzedaży papierów wartościowych		1,279,040
Należności z subskrypcji		22,491
Należności z tytułu odsetek i dywidend	3.12	-
Rozliczenia międzyokresowe kosztów	3.13	8,749
Należność z tytułu umów z otrzymanym przyrzeczeniem odkupu	3.10, 17	-
Niezrealizowany zysk netto z kontraktów term. forward	3.4, 11	63
Niezrealizowany zysk z kontraktów futures	3.5, 12	-
Niezrealizowany zysk z kontraktów swap stóp procentowych	3.7, 15	-
Inne należności		37,055

Aktywa ogółem

99,550,353

PASYWA

Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 14	-
Wartość rynkowa opcji	3.6, 13	909,840
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	3.12	-
Zobowiązania z tytułu nabycia papierów wartościowych		-
Zobowiązania z tytułu umorzeń		392,855
Zobowiązania z tytułu podatków i inne koszty	6	155,102
Niezrealizowana strata z kontraktów walutowych	3.4, 11	102,145
Niezrealizowana strata z kontraktów futures	3.5, 12	-
Niezrealizowana strata z kontraktów swap stóp procentowych	3.7, 15	-
Inne wymagane płatności		182

Pasywa ogółem

1,560,124

Aktywa netto razem

97,990,229

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Skonsolidowane zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za kończący się 30 czerwca 2023 roku

	Noty	EUR
Wartość Aktywów Netto na początek okresu		4,788,073,756
DOCHODY		
Dywidendy netto	3.12	23,347,918
Odsetki z tytułu obligacji netto	3.12	30,590,359
Odsetki bankowe netto	3.12	1,936,721
Odsetki od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	120,919
Inne dochody		489,335
		56,485,251
KOSZTY		
Opłaty za zarządzanie	5	16,896,016
Opłaty na rzecz depozytariusza	7	208,106
Odsetki bankowe netto	3.12	792,619
Odsetki od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	1,763,621
Podatek roczny	8	658,045
Amortyzacja wydatków na utworzenie subfunduszy	3.11	2,192
Koszty audytu i prawne		289,077
Koszty administracyjne	7	1,227,614
Inne koszty		1,841,647
		23,678,936

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Skonsolidowane zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za kończący się 30 czerwca 2023 roku

	Noty	EUR
Zysk/(strata) netto z inwestycji:		32,806,315
Zrealizowany zysk/(strata) netto z tytułu:		
- inwestycji	3.2	(99,380,781)
- operacji walutowych	3.3	104,732
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	15,971,718
- kontraktów futures	3.5	(5,454,023)
- opcji	3.6	(746,430)
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	(1,876,073)
Zrealizowana strata netto za okres		(91,380,855)
Zmiana niezrealizowanego zysku/(straty) z tytułu:		
- inwestycji	3.2	448,057,019
- operacji walutowych	3.3	492,384
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	(6,619,038)
- kontraktów futures	3.5	(9,009,373)
- opcji	3.6	1,018,421
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	(7,108,496)
		426,830,917
Zysk/(strata) netto z operacji		368,256,377
Nabycia	4	360,935,226
Umorzenia	4	(981,571,578)
Wyłączone dywidendy	2	(3,095,308)
Przeszacowanie waluty*	3.3	(58,069,724)
Wartość Aktywów Netto na koniec okresu		4,474,528,749

* 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 2022 roku oraz kursach obowiązujących na dzień 30 czerwca 2023 roku.

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres kończący się 30 czerwca 2023 roku

	Noty	SANTANDER GO NORTH AMERICAN EQUITY USD
Wartość Aktywów Netto na początek okresu		577,829,978
DOCHODY		
Dywidendy netto	3.12	636,787
Odsetki z tytułu obligacji netto	3.12	-
Odsetki bankowe netto	3.12	62,425
Odsetki netto od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
Inne dochody		-
Dochody ogółem		699,212
KOSZTY		
Opłaty za zarządzanie	5	2,138,661
Opłaty na rzecz depozytariusza	7	19,933
Odsetki bankowe netto	3.12	-
Odsetki netto od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
Podatek roczny	8	64,344
Amortyzacja wydatków na utworzenie subfunduszy	3.11	-
Koszty audytu i prawne		15,855
Koszty administracyjne	7	45,584
Inne koszty		211,313
Koszty ogółem		2,495,690

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres kończący się 30 czerwca 2023 roku

	Noty	SANTANDER GO NORTH AMERICAN EQUITY USD
Zysk/(strata) netto z inwestycji		(1,796,478)
Zrealizowany zysk/(strata) netto z tytułu:		
- inwestycji	3.2	(53,434,890)
- operacji walutowych	3.3	(603,102)
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	4,171,496
- kontraktów futures	3.5	-
- opcji	3.6	(3,083,383.41)
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
Zrealizowany zysk/(strata) netto za okres		(49,866,496)
Zmiana niezrealizowanego zysku/(straty) z tytułu:		
- inwestycji	3.2	249,018,046
- operacji walutowych	3.3	1,434
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	(2,001,767)
- kontraktów futures	3.5	-
- opcji	3.6	(131,873)
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
Zmiana niezrealizowanego zysku/(straty) w okresie		246,885,840
Zysk/(strata) netto z operacji		195,222,866
Nabycia	4	36,920,472
Umorzenia	4	(149,684,370)
Wyłacone dywidendy	2	-
Wartość Aktywów Netto na koniec okresu		660,288,946

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres kończący się 30 czerwca 2023 roku

	Noty	SANTANDER AM EURO EQUITY EUR
Wartość Aktywów Netto na początek okresu		442,781,067
DOCHODY		
Dywidendy netto	3.12	11,404,847
Odsetki z tytułu obligacji netto	3.12	-
Odsetki bankowe netto	3.12	61,892
Odsetki netto od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
Inne dochody		-
Dochody ogółem		11,466,739
KOSZTY		
Opłaty za zarządzanie	5	570,380
Opłaty na rzecz depozytariusza	7	23,109
Odsetki bankowe netto	3.12	235
Odsetki netto od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
Podatek roczny	8	31,442
Amortyzacja wydatków na utworzenie subfunduszy	3.11	-
Koszty audytu i prawne		16,283
Koszty administracyjne	7	49,603
Inne koszty		170,073
Koszty ogółem		861,125

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres kończący się 30 czerwca 2023 roku

	Noty	SANTANDER AM EURO EQUITY EUR
Zysk/(strata) netto z inwestycji		10,605,614
Zrealizowany zysk/(strata) netto z tytułu:		
- inwestycji	3.2	23,007,640
- operacji walutowych	3.3	163
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	-
- kontraktów futures	3.5	(152,866)
- opcji	3.6	-
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
Zrealizowany zysk/(strata) netto za okres		22,854,937
Zmiana niezrealizowanego zysku/(straty) z tytułu:		
- inwestycji	3.2	15,822,139
- operacji walutowych	3.3	(16,449)
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	-
- kontraktów futures	3.5	(69,694)
- opcji	3.6	-
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
Zmiana niezrealizowanego zysku/(straty) w okresie		15,735,996
Zysk/(strata) netto z operacji		49,196,547
Nabycia	4	3,916,488
Umorzenia	4	(28,599,558)
Wyłacone dywidendy	2	-
Wartość Aktywów Netto na koniec okresu		467,294,544

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres kończący się 30 czerwca 2023 roku

	Noty	SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG USD
Wartość Aktywów Netto na początek okresu		526,393,923
DOCHODY		
Dywidendy netto	3.12	3,788,896
Odsetki z tytułu obligacji netto	3.12	-
Odsetki bankowe netto	3.12	-
Odsetki netto od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	103,096
Inne dochody		-
Dochody ogółem		3,891,992
KOSZTY		
Opłaty za zarządzanie	5	2,342,056
Opłaty na rzecz depozytariusza	7	19,055
Odsetki bankowe netto	3.12	-
Odsetki netto od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
Podatek roczny	8	82,379
Amortyzacja wydatków na utworzenie subfunduszy	3.11	-
Koszty audytu i prawne		15,239
Koszty administracyjne	7	176,989
Inne koszty		293,595
Koszty ogółem		2,929,313

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres kończący się 30 czerwca 2023 roku

SANTANDER GO
GLOBAL EQUITY ESG
USD

	Noty	
Zysk/(strata) netto z inwestycji		962,679
Zrealizowany zysk/(strata) netto z tytułu:		
- inwestycji	3.2	(12,908,765)
- operacji walutowych	3.3	(72,892)
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	12,357,065
- kontraktów futures	3.5	-
- opcji	3.6	-
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
Zrealizowany zysk/(strata) netto za okres		(624,592)
Zmiana niezrealizowanego zysku/(straty) z tytułu:		
- inwestycji	3.2	87,596,830
- operacji walutowych	3.3	10,478
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	(4,146,141)
- kontraktów futures	3.5	-
- opcji	3.6	-
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
Zmiana niezrealizowanego zysku/(straty) w okresie		83,461,167
Zysk/(strata) netto z operacji		83,799,254
Nabycia	4	34,200,427
Umorzenia	4	(85,919,995)
Wyłacone dywidendy	2	-
Wartość Aktywów Netto na koniec okresu		558,473,609

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres kończący się 30 czerwca 2023 roku

	Noty	SANTANDER GO DYNAMIC BOND	USD
Wartość Aktywów Netto na początek okresu		128,367,306	
DOCHODY			
Dywidendy netto	3.12	-	
Odsetki z tytułu obligacji netto	3.12	1,716,577	
Odsetki bankowe netto	3.12	64,704	
Odsetki netto od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	106,064	
Inne dochody		288,538	
Dochody ogółem		2,175,883	
KOSZTY			
Opłaty za zarządzanie	5	522,340	
Opłaty na rzecz depozytariusza	7	-	
Odsetki bankowe netto	3.12	140	
Odsetki netto od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	649,176	
Podatek roczny	8	17,826	
Amortyzacja wydatków na utworzenie subfunduszy	3.11	-	
Koszty audytu i prawne		14,943	
Koszty administracyjne	7	76,565	
Inne koszty		67,153	
Koszty ogółem		1,348,143	

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres kończący się 30 czerwca 2023 roku

SANTANDER GO
DYNAMIC BOND

	Noty		USD
Zysk/(strata) netto z inwestycji		827,740	
Zrealizowany zysk/(strata) netto z tytułu:			
- inwestycji	3.2	(975,483)	
- operacji walutowych	3.3	747,577	
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	1,818,556	
- kontraktów futures	3.5	685,472	
- opcji	3.6	233,325	
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	(1,588,834)	
Zrealizowany zysk/(strata) netto za okres		920,613	
Zmiana niezrealizowanego zysku/(straty) z tytułu:			
- inwestycji	3.2	625,098	
- operacji walutowych	3.3	(3,185)	
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	(901,839)	
- kontraktów futures	3.5	(222,436)	
- opcji	3.6	1,141,962	
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	523,913	
Zmiana niezrealizowanego zysku/(straty) w okresie		1,163,513	
Zysk/(strata) netto z operacji		2,911,866	
Nabycia	4	13,379,601	
Umorzenia	4	(19,101,758)	
Wyłacone dywidendy	2	-	
Wartość Aktywów Netto na koniec okresu		125,557,015	

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres kończący się 30 czerwca 2023 roku

	Noty	SANTANDER FUTURE WEALTH USD
Wartość Aktywów Netto na początek okresu		103,707,094
DOCHODY		
Dywidendy netto	3.12	7,014
Odsetki z tytułu obligacji netto	3.12	-
Odsetki bankowe netto	3.12	43,265
Odsetki netto od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
Inne dochody		52,791
Dochody ogółem		103,070
KOSZTY		
Opłaty za zarządzanie	5	394,782
Opłaty na rzecz depozytariusza	7	2,040
Odsetki bankowe netto	3.12	1,829
Odsetki netto od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
Podatek roczny	8	5,864
Amortyzacja wydatków na utworzenie subfunduszy	3.11	-
Koszty audytu i prawne		8,593
Koszty administracyjne	7	25,055
Inne koszty		37,230
Koszty ogółem		475,393

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres kończący się 30 czerwca 2023 roku

			SANTANDER FUTURE WEALTH
	Noty		USD
Zysk/(strata) z inwestycji		(372,323)	
Zrealizowany zysk/(strata) netto z tytułu:			
- inwestycji	3.2	(6,284,036)	
- operacji walutowych	3.3	10,478	
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	1,479,891	
- kontraktów futures	3.5	206,282	
- opcji	3.6	91,087	
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-	
Zrealizowany zysk/(strata) netto za okres		(4,496,298)	
Zmiana niezrealizowanego zysku/(straty) z tytułu:			
- inwestycji	3.2	16,630,651	
- operacji walutowych	3.3	(15,850)	
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	(387,926)	
- kontraktów futures	3.5	64,480	
- opcji	3.6	(1,117,269)	
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-	
Zmiana niezrealizowanego zysku/(straty) w okresie		15,174,086	
Zysk/(strata) netto z operacji		10,305,465	
Nabycia	4	4,457,369	
Umorzenia	4	(20,479,699)	
Wyłacone dywidendy	2	-	
Wartość Aktywów Netto na koniec okresu		97,990,229	

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Dane statystyczne (c.d.)

SANTANDER GO NORTH AMERICAN EQUITY

		30 czerwca 2023	31 grudnia 2022	31 grudnia 2021
Wartość Aktywów Netto	USD	660,288,946	577,829,978	1,911,301,688.27
Klasa A				
Liczba wyemitowanych tytułów		803,468.78	809,836.45	1,112,053.37
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	20.59	15.40	33.71
Klasa B				
Liczba wyemitowanych tytułów		3,544,920.82	3,994,247.42	7,176,728.27
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	23.74	17.70	38.46
Klasa BEH				
Liczba wyemitowanych tytułów		400,868.90	427,778.17	518,566.42
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	90.52	68.41	155.83
Klasa C				
Liczba wyemitowanych tytułów		1,399,965.74	1,504,669.47	1,333,974.48
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	10.64	7.93	17.26
Klasa I				
Liczba wyemitowanych tytułów		1,060,116.05	340,204.51	12,488,208.53
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	11.03	8.19	17.67
Klasa M				
Liczba wyemitowanych tytułów		1,593,233.46	1,632,145.12	2,019,039.22
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	108.58	80.56	173.56
Klasa ME				
Liczba wyemitowanych tytułów		2,202,409.40	2,959,590.40	3,835,592.46
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	124.91	94.83	191.73
Klasa RKP				
Liczba wyemitowanych tytułów		1,603.90	1,138.47	64.09
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	GBP	68.93	51.40	98.54
Klasa SE				
Liczba wyemitowanych tytułów		17,395.05	4,693.20	3,903.54
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	105.53	80.17	162.28
Klasa V				
Liczba wyemitowanych tytułów		146,726.38	213,343.27	486,172.99
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	121.51	80.74	153.85

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Dane statystyczne (c.d.)

SANTANDER AM EURO EQUITY

		30 czerwca 2023	31 grudnia 2022	31 grudnia 2021
Wartość Aktywów Netto	EUR	467,294,544	442,781,067	670,102,317.25
Klasa A				
Liczba wyemitowanych tytułów		197,752.00	203,120.78	203,098.10
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	191.35	173.51	201.08
Klasa AU				
Liczba wyemitowanych tytułów		2,286.57	2,458.63	3,075.10
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	116.05	103.10	127.95
Klasa B				
Liczba wyemitowanych tytułów		23,665.59	34,725.82	43,197.97
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	140.84	127.39	146.89
Klasa I				
Liczba wyemitowanych tytułów		8,779.99	8,352.71	13,352.12
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	1,824.70	1,642.75	1,876.63
Klasa IKP				
Liczba wyemitowanych tytułów		6,792.94	6,792.94	44,999.48
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	GBP	2,172.15	2,016.48	2,172.27
Klasa M				
Liczba wyemitowanych tytułów		3,137,246.94	3,325,529.61	3,768,078.14
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	125.17	112.38	127.68

Dane statystyczne (c.d.)

		30 czerwca 2023	31 grudnia 2022	31 grudnia 2021
Wartość Aktywów Netto	USD	558,473,609	526,393,923	681,950,942
Klasa A				
Liczba wyemitowanych tytułów		24,228.24	25,363.05	39,276.89
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	118.05	103.03	129.63
Klasa AE				
Liczba wyemitowanych tytułów		420,889.32	398,290.08	250,156.68
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	168.55	150.52	177.74
Klasa AEH				
Liczba wyemitowanych tytułów		10.00	10.00	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł		91.96	81.36	-
Klasa B				
Liczba wyemitowanych tytułów		212,453.79	237,615.06	430,165.19
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	120.07	104.58	131.06
Klasa BE				
Liczba wyemitowanych tytułów		595,013.16	617,359.78	383,711.76
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	170.78	152.21	179.01
Klasa BEH				
Liczba wyemitowanych tytułów		339,172.28	342,150.53	187,677.74
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	111.53	98.53	127.41
Klasa I				
Liczba wyemitowanych tytułów		559,750.80	581,819.41	66,538.06
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	121.86	105.81	131.75
Klasa IKP				
Liczba wyemitowanych tytułów		45,000.00	45,000.00	45,000.00
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	GBP	120.48	109.37	122.00
Klasa M				
Liczba wyemitowanych tytułów		1,103,906.07	1,608,162.62	2,055,769.79
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	125.38	108.86	135.25
Klasa RKP				
Liczba wyemitowanych tytułów		11,123,252.54	8,077,885.32	4,908,981.26
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	GBP	1.33	1.21	1.35
Klasa SE				
Liczba wyemitowanych tytułów		16,352.35	17,064.48	2,992.74
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	112.28	99.77	116.62
Klasa V				
Liczba wyemitowanych tytułów		337,476.71	497,644.36	968,694.14
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	195.85	151.83	166.22

Dane statystyczne (c.d.)

		30 czerwca 2023	31 grudnia 2022	31 grudnia 2021
Wartość Aktywów Netto	USD	125,557,015	128,367,306	251,406,613.67
Klasa A				
Liczba wyemitowanych tytułów		24,772.30	21,602.66	14,555.72
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	94.04	92.85	102.95
Klasa B				
Liczba wyemitowanych tytułów		196,869.40	228,288.64	471,184.13
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	95.24	93.86	103.71
Klasa BEH				
Liczba wyemitowanych tytułów		364,988.61	383,299.57	302,821.64
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	87.68	87.46	98.74
Klasa I				
Liczba wyemitowanych tytułów		51.77	51.77	463,190.00
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	97.74	95.98	105.23
Klasa IEH				
Liczba wyemitowanych tytułów		15,539.95	15,539.95	32,358.84
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	88.73	88.22	99.00
Klasa M				
Liczba wyemitowanych tytułów		379,969.36	376,904.30	700,372.44
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	93.64	91.89	100.65
Klasa MEH				
Liczba wyemitowanych tytułów		332,650.66	349,440.48	395,483.80
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	88.84	88.25	98.83
Klasa RKP				
Liczba wyemitowanych tytułów		1,311.14	1,147.80	76.56
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	GBP	99.48	103.29	101.09

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Dane statystyczne (c.d.)

SANTANDER FUTURE WEALTH

		30 czerwca 2023	31 grudnia 2022	31 grudnia 2021
Wartość Aktywów Netto	USD	97,990,229	103,707,094	228,961,238
Klasa A				
Liczba wyemitowanych tytułów		367,903.33	419,436.26	892,726.56
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	80.95	74.25	101.83
Klasa AE				
Liczba wyemitowanych tytułów		203,913.02	226,937.33	221,950.09
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	90.18	84.63	108.93
Klasa AEH				
Liczba wyemitowanych tytułów		7,190.67	50.00	50.00
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	73.12	68.03	96.72
Klasa APH				
Liczba wyemitowanych tytułów		1,046.00	875.64	50.00
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	GBP	76.04	70.09	98.51
Klasa M				
Liczba wyemitowanych tytułów		128,297.97	161,897.11	321,787.30
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	82.92	75.54	102.24
Klasa RKP				
Liczba wyemitowanych tytułów		994.28	965.14	508.04
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	GBP	89.43	86.36	104.42
Klasa V				
Liczba wyemitowanych tytułów		89,245.76	133,940.14	279,603.21
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	95.55	77.83	93.63
Klasa X				
Liczba wyemitowanych tytułów		198,805.70	246,966.50	385,843.23
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	82.05	74.83	101.48
Klasa XE				
Liczba wyemitowanych tytułów		115,092.54	114,475.90	96,116.27
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	94.36	88.04	112.06

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER GO NORTH AMERICAN EQUITY

Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2023 r.

Opis	Waluta	Ilość	Koszt USD	Wartość rynkowa USD	% WAN
Zbywalne papiery wartościowe dopuszczone do oficjalnego notowania na giełdzie lub znajdujące się w obrocie na innym rynku regulowanym - ogółem					
Akcje					
Kanada					
SHOPIFY INC COMMON STOCK	CAD	764,939	56,894,528	49,415,059	7.48%
Kanada razem			56,894,528	49,415,059	7.48%
Holandia					
ADYEN NV COMMON STOCK	EUR	14,929	24,715,242	25,828,779	3.91%
ASML HOLDING NV NY REG	USD	9,130	5,678,501	6,616,968	1.00%
Holandia razem			30,393,743	32,445,747	4.91%
Wielka Brytania					
ROYALTY PHARMA PLC	USD	918,894	38,800,521	28,246,802	4.28%
Wielka Brytania razem			38,800,521	28,246,802	4.28%
Stany Zjednoczone					
AIRBNB INC COMMON STOCK	USD	156,045	22,472,443	19,998,727	3.03%
ALPHABET INC COMMON	USD	27,214	2,778,696	3,292,078	0.50%
AMAZON.COM INC COMMON	USD	188,787	22,268,165	24,610,273	3.73%
BILL.COM HOLDINGS INC	USD	180,220	17,061,382	21,058,707	3.19%
BLOCK INC COMMON STOCK	USD	151,704	21,447,314	10,098,935	1.53%
CHEWY INC COMMON STOCK	USD	603,802	31,975,117	23,832,065	3.61%
CLOUDFLARE INC COMMON	USD	676,775	53,793,855	44,240,782	6.70%
DATADOG INC	USD	176,377	17,648,754	17,351,969	2.63%
FLOOR & DECOR HOLDINGS	USD	160,570	12,312,351	16,692,857	2.53%
ILLUMINA INC COMMON	USD	157,051	36,002,205	29,445,492	4.46%
INTERCONTINENTAL	USD	159,585	16,556,346	18,045,872	2.73%
MERCADOLIBRE INC COMMON	USD	13,936	17,235,335	16,508,586	2.50%
META PLATFORMS INC	USD	72,322	8,774,839	20,754,968	3.14%
ROBLOX CORP COMMON STOCK	USD	802,492	49,560,059	32,340,428	4.90%
SNOWFLAKE INC COMMON	USD	259,801	63,285,049	45,719,780	6.92%
TESLA INC COMMON STOCK	USD	113,279	20,207,791	29,653,044	4.49%
TRADE DESK INC/THE	USD	603,275	46,308,021	46,584,896	7.06%
UBER TECHNOLOGIES INC	USD	1,329,072	60,733,997	57,376,037	8.69%
VEEVA SYSTEMS INC COMMON	USD	47,341	11,228,309	9,360,736	1.42%
ZOOMINFO TECHNOLOGIES	USD	596,591	24,230,954	15,147,445	2.29%
TOTAL UNITED STATES OF AMERICA			580,221,889	534,482,438	80.95%
Akcje ogółem			706,310,681	644,590,046	97.62%
Zbywalne papiery wartościowe dopuszczone do oficjalnego notowania na giełdzie lub znajdujące się w obrocie na innym rynku regulowanym - ogółem			706,310,681	644,590,046	97.62%
Inwestycje ogółem			706,310,681	644,590,046	97.62%

Informacje dodatkowe stanowią integralną część niniejszych sprawozdań finansowych

Klasyfikacja geograficzna inwestycji na dzień 30 czerwca 2023 r.

	% WAN
Stany Zjednoczone	80.95%
Kanada	7.48%
Holandia	4.91%
Wielka Brytania	4.28%
Razem	97.62%

Ekonomiczna klasyfikacja inwestycji na dzień 30 czerwca 2023 r.

	% WAN
Różne	31.93%
Przetwarzanie danych	18.32%
Handel	17.27%
Transport (żegluga)	8.69%
Zdrowotne/osobiste	5.70%
Auta osobowe	4.49%
Elektryczne i elektronika	4.69%
Wypoczynek / turystyka	3.03%
Usługi finansowe	2.73%
Komponenty elektroniczne	1.00%
Razem	97.62%

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER AM EURO EQUITY

Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2023 r.

Opis	Waluta	Ilość	Koszt EUR	Wartość rynkowa EUR	% WAN
Zbywalne papiery wartościowe dopuszczone do oficjalnego notowania na giełdzie lub znajdujące się w obrocie na innym rynku regulowanym – ogółem					
Akcje					
Belgia					
ANHEUSER-BUSCH INBEV	EUR	106,455	6,182,371	5,517,563	1.18%
Belgia razem			6,182,371	5,517,563	1.18%
Finlandia					
NOKIA OYJ COMMON STOCK	EUR	2,055,723	9,860,319	7,884,726	1.69%
Finlandia razem			9,860,319	7,884,726	1.69%
Francja					
AIR LIQUIDE SA COMMON	EUR	52,117	7,279,102	8,557,611	1.83%
AXA SA COMMON STOCK EUR	EUR	356,889	8,671,115	9,644,925	2.06%
BNP PARIBAS SA COMMON	EUR	177,882	10,378,303	10,267,349	2.20%
CARREFOUR SA COMMON	EUR	348,425	6,362,388	6,046,916	1.29%
CIE DE SAINT-GOBAIN	EUR	142,549	5,929,424	7,944,256	1.70%
CIE GENERALE DES	EUR	120,671	3,025,755	3,265,357	0.70%
DANONE SA COMMON STOCK	EUR	125,514	7,074,469	7,046,356	1.51%
ESSILORLUXOTTICA SA	EUR	49,888	7,331,399	8,610,669	1.84%
FAURECIA SE COMMON STOCK	EUR	164,087	3,688,449	3,539,357	0.76%
KERING SA COMMON STOCK	EUR	11,552	6,903,696	5,840,691	1.25%
LVMH MOET HENNESSY LOUIS	EUR	37,648	14,932,467	32,490,224	6.95%
PUBLICIS GROUPE SA	EUR	88,185	3,677,906	6,481,598	1.39%
SANOFI COMMON STOCK EUR	EUR	158,166	12,771,001	15,531,901	3.32%
SODEXO SA COMMON STOCK	EUR	66,456	5,075,508	6,702,088	1.43%
SPIE SA COMMON STOCK EUR	EUR	125,822	3,725,762	3,724,331	0.80%
TELEPERFORMANCE COMMON	EUR	44,373	7,258,994	6,809,037	1.46%
TOTALENERGIES SE COMMON	EUR	114,445	4,241,311	6,014,085	1.29%
VINCI SA COMMON STOCK	EUR	118,170	10,334,117	12,570,925	2.69%
Francja razem			128,661,166	161,087,676	34.47%
Niemcy					
RWE AG COMMON STOCK EUR	EUR	187,040	7,655,553	7,457,285	1.60%
SAP SE COMMON STOCK EUR	EUR	88,417	10,259,713	11,064,503	2.37%
SIEMENS AG COMMON STOCK	EUR	133,437	16,341,336	20,354,480	4.36%
WACKER CHEMIE AG COMMON	EUR	19,841	2,757,719	2,495,006	0.53%
DEUTSCHE BOERSE AG	EUR	54,070	7,832,399	9,143,237	1.96%
DEUTSCHE POST AG COMMON	EUR	117,147	3,186,594	5,239,985	1.12%
DEUTSCHE TELEKOM AG	EUR	591,511	9,033,360	11,816,024	2.53%
INFINEON TECHNOLOGIES AG	EUR	264,009	7,795,638	9,975,580	2.13%
MUENCHENER	EUR	14,510	3,667,471	4,985,636	1.07%
Niemcy razem			99,690,955	110,155,701	23.58%
Irlandia					
LINDE PLC	EUR	18,713	3,717,733	6,540,194	1.40%
Irlandia razem			3,717,733	6,540,194	1.40%

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER AM EURO EQUITY

Włochy					
ENEL SPA COMMON STOCK	EUR	1,968,013	11,440,233	12,138,704	2.60%
ENI SPA COMMON STOCK EUR	EUR	621,963	8,868,416	8,198,716	1.75%
INTESA SANPAOLO SPA	EUR	1,662,845	3,872,110	3,990,828	0.85%
UNICREDIT SPA COMMON	EUR	369,113	6,219,874	7,849,188	1.68%
Włochy razem			<u>30,400,633</u>	<u>32,177,436</u>	<u>6.88%</u>
Portugalia					
EDP - ENERGIAS DE	EUR	1,647,953	5,835,074	7,376,238	1.58%
Portugalia razem			<u>5,835,074</u>	<u>7,376,238</u>	<u>1.58%</u>
Hiszpania					
ACERINOX SA COMMON STOCK	EUR	309,503	2,898,835	3,009,607	0.64%
BANCO SANTANDER SA	EUR	2,514,235	9,322,050	8,510,685	1.82%
CELLNEX TELECOM SA	EUR	163,678	7,144,121	6,054,449	1.30%
GRIFOLS SA COMMON STOCK	EUR	379,148	4,891,973	4,451,198	0.95%
IBERDROLA SA COMMON	EUR	616,264	6,608,999	7,364,355	1.58%
INDUSTRIA DE DISEÑO	EUR	265,112	6,859,099	9,400,872	2.01%
Hiszpania razem			<u>37,725,077</u>	<u>38,791,166</u>	<u>8.30%</u>
Szwajcaria					
DSM-FIRMENICH AG COMMON	CHF	38,461	4,789,012	3,793,024	0.81%
Szwajcaria razem			<u>4,789,012</u>	<u>3,793,024</u>	<u>0.81%</u>
Holandia					
AIRBUS SE COMMON STOCK	EUR	135,539	14,659,127	17,939,942	3.84%
ASML HOLDING NV COMMON	EUR	37,625	13,618,720	24,945,373	5.34%
ING GROEP NV COMMON	EUR	806,456	8,254,772	9,950,054	2.13%
STELLANTIS NV COMMON	EUR	472,428	6,362,900	7,596,642	1.63%
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	EUR	247,137	6,046,785	5,029,238	1.08%
Holandia razem			<u>48,942,304</u>	<u>65,461,249</u>	<u>14.02%</u>
Wielka Brytania					
COCA-COLA EUROPACIFIC	USD	64,530	3,317,450	3,807,270	0.81%
SHELL PLC COMMON STOCK	EUR	172,907	3,479,113	4,771,369	1.02%
Wielka Brytania razem			<u>6,796,563</u>	<u>8,578,639</u>	<u>1.83%</u>
Akcje ogółem			<u>382,601,207</u>	<u>447,363,612</u>	<u>95.74%</u>
Zbywalne papiery wartościowe dopuszczone do oficjalnego notowania na giełdzie lub znajdujące się w obrocie na innym rynku regulowanym - ogółem					
			<u>382,601,207</u>	<u>447,363,612</u>	<u>95.74%</u>
Inwestycje ogółem			<u>382,601,207</u>	<u>447,363,612</u>	<u>95.74%</u>

Klasyfikacja geograficzna inwestycji na dzień 30 czerwca 2023 r.

	% WAN
Francja	34.47%
Niemcy	23.58%
Holandia	14.02%
Hiszpania	8.30%
Włochy	6.88%
Wielka Brytania	1.83%
Finlandia	1.69%
Portugalia	1.58%
Irlandia	1.40%
Belgia	1.18%
Szwajcaria	0.81%
	95.74%

Ekonomiczna klasyfikacja inwestycji na dzień 30 czerwca 2023 r.

	% WAN
Tekstylnia / odzież	11.02%
Bankowość	8.68%
Komponenty elektroniczne	7.47%
Usługi komunalne	7.36%
Zdrowie	5.78%
Ubezpieczenia	5.03%
Różne	4.73%
Samochody	4.61%
Substancje chemiczne	4.57%
Komponenty przemysłowe	4.36%
Źródła energii	4.06%
Przemysł lotniczy	3.84%
Telekomunikacja	3.83%
Żywność / gospodarstwo domowe	3.61%
Budownictwo (mieszaniowe)	2.69%
Przetwarzanie danych	2.37%
Handel	2.01%
Usługi finansowe	1.96%
Materiały budowlane	1.70%
Elektryka i elektronika	1.69%
Wypoczynek / turystyka	1.43%
Napoje i produkty tytoniowe	1.18%
Transport (linie lotnicze)	1.12%
Branża maszynowa i inżynierska	0.64%
Razem	95.74%

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG**Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2023 (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>					
Akcje					
Dania					
NOVO NORDISK A/S COMMON	DKK	50,983	7,516,734	8,212,739	1.47%
Dania razem			7,516,734	8,212,739	1.47%
Finlandia					
NESTE OYJ COMMON STOCK	EUR	121,172	6,351,343	4,661,324	0.83%
Finlandia razem			6,351,343	4,661,324	0.83%
Francja					
LVMH MOET HENNESSY LOUIS SCHNEIDER ELECTRIC SE	EUR EUR	8,975 62,760	8,346,375 9,885,327	8,450,259 11,397,709	1.51% 2.04%
Francja razem			18,231,702	19,847,968	3.55%
Niemcy					
ALLIANZ SE COMMON STOCK DEUTSCHE BOERSE AG INFINEON TECHNOLOGIES AG	EUR EUR EUR	55,160 61,899 129,671	13,351,225 10,629,524 5,307,674	12,830,282 11,419,629 5,345,484	2.30% 2.04% 0.96%
Niemcy razem			29,288,423	9,609,659.80	5.30%
Irlandia					
ACCENTURE PLC COMMON LINDE PLC TRANE TECHNOLOGIES PLC	USD EUR USD	34,123 35,151 37,892	11,568,886 11,277,655 6,464,355	10,529,675 13,395,551 7,247,224	1.89% 2.40% 1.30%
Irlandia razem			29,310,896	31,172,450	5.59%
Izrael					
CHECK POINT SOFTWARE	USD	77,397	10,459,310	9,722,611	1.74%
Izrael razem			10,459,310	9,722,611	1.74%
Japonia					
KEYENCE CORP COMMON SONY GROUP CORP COMMON SUMITOMO MITSUI	JPY JPY JPY	17,500 162,600 242,800	7,330,340 15,876,229 10,034,429	8,215,138 14,585,457 10,346,319	1.47% 2.61% 1.85%
Japonia razem			33,240,998	33,146,914	5.93%
Holandia					
SIGNIFY NV COMMON STOCK STMICROELECTRONICS NV	EUR EUR	149,144 187,959	7,848,637 9,118,711	4,176,922 9,343,708	0.75% 1.67%
Holandia razem			16,967,348	13,520,630	2.42%
Wielka Brytania					
ASTRAZENECA PLC COMMON HALEON PLC COMMON STOCK RELX PLC COMMON STOCK	GBP GBP GBP	142,731 2,684,828 524,195	17,029,111 10,333,533 16,175,671	20,461,549 10,999,540 17,467,270	3.66% 1.97% 3.13%

Informacje dodatkowe stanowią integralną część niniejszych sprawozdań finansowych

Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2023 (c.d.)

UNILEVER PLC COMMON		GBP	235,833	11,859,084	12,285,382	2.20%
Wielka Brytania razem				55,397,399	61,213,741	10.96%
Stany Zjednoczone						
<i>UNITED STATES OF AMERICA</i>						
ADVANCED MICRO DEVICES	USD		67,999	5,487,301	7,745,766	1.39%
AECOM COMMON STOCK USD	USD		58,190	4,807,494	4,928,111	0.88%
ALPHABET INC COMMON	USD		213,871	24,936,930	25,600,359	4.58%
AMAZON.COM INC COMMON	USD		115,123	17,106,260	15,007,434	2.69%
APPLE INC COMMON STOCK	USD		163,287	24,608,229	31,672,779	5.67%
AUTOZONE INC COMMON	USD		4,401	9,033,551	10,973,277	1.96%
BANK OF AMERICA CORP	USD		421,822	15,386,276	12,102,073	2.17%
CBRE GROUP INC COMMON	USD		73,490	6,779,464	5,931,378	1.06%
CHENIERE ENERGY INC	USD		68,096	8,011,793	10,375,107	1.86%
COSTCO WHOLESALE CORP	USD		27,642	13,571,271	14,881,900	2.66%
CROWN HOLDINGS INC	USD		87,527	9,947,681	7,603,470	1.36%
DEERE & CO COMMON STOCK	USD		20,158	6,946,748	8,167,820	1.46%
ELI LILLY & CO COMMON	USD		51,108	14,619,069	23,968,630	4.29%
HOME DEPOT INC/THE	USD		16,288	4,825,225	5,059,704	0.91%
MARSH & MCLENNAN COS INC	USD		61,965	9,533,365	11,654,377	2.09%
META PLATFORMS INC	USD		57,568	14,578,631	16,520,865	2.96%
MICROSOFT CORP COMMON	USD		100,710	28,192,118	34,295,785	6.14%
MOTOROLA SOLUTIONS INC	USD		28,513	7,151,025	8,362,293	1.50%
NIKE INC COMMON STOCK	USD		48,306	5,127,816	5,331,533	0.95%
NVIDIA CORP COMMON STOCK	USD		34,198	7,882,749	14,466,438	2.59%
S&P GLOBAL INC COMMON	USD		21,026	8,540,459	8,429,113	1.51%
THERMO FISHER SCIENTIFIC	USD		26,182	14,600,241	13,660,459	2.45%
UNITEDHEALTH GROUP INC	USD		30,124	13,551,306	14,478,799	2.59%
VISA INC COMMON STOCK	USD		80,765	17,522,489	19,180,072	3.43%
Stany Zjednoczone razem				292,747,491	330,397,542	59.15%
Akcje ogółem				499,511,644	541,491,314	96.94%
Zbywalne papiery wartościowe dopuszczone do oficjalnego notowania na giełdzie lub znajdujące się w obrocie na innym rynku regulowanym - ogółem				499,511,644	541,491,314	96.94%
Inwestycje ogółem				499,511,644	541,491,314	96.94%

Klasyfikacja geograficzna inwestycji na dzień 30 czerwca 2023 r.

	% WAN
Stany Zjednoczone	59.15%
Wielka Brytania	10.96%
Japonia	5.93%
Irlandia	5.59%
Niemcy	5.30%
Francja	3.55%
Holandia	2.42%
Izrael	1.74%
Dania	1.47%
Finlandia	0.83%
Razem	96.94%

Ekonomiczna klasyfikacja inwestycji na dzień 30 czerwca 2023 r.

	% WAN
Zdrowotne / osobiste	16.18%
Przetwarzanie danych	13.20%
Elektryczne i elektronika	12.41%
Różne	10.67%
Komponenty elektroniczne	8.08%
Merchandising	5.56%
Ubezpieczenia	4.39%
Banowość	4.02%
Usługi finansowe	3.55%
Zróżnicowanie energii	2.69%
Żywność / gospodarstwo domowe	2.66%
Materiały budowlane	2.66%
Urządzenia	2.61%
Tekstylna/Odzież	2.46%
Przemysł chemiczny	2.40%
Branża maszynowa i inżynierska	1.46%
Nieruchomości	1.06%
Budownictwo (mieszaniowe)	0.88%
Total	96.94%

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER GO DYNAMIC BOND

Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2023 (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>					
Obligacje					
Australia					
SANTOS 3.649% 04/31	USD	400,000	400,122	332,428	0.26%
TOTAL AUSTRALIA			400,122	332,428	0.26%
Austra					
ERSTE GROUP BANK AG VAR 12/64	EUR	200,000	258,541	211,575	0.17%
TOTAL AUSTRIA			258,541	211,575	0.17%
Bermudy					
MARVELL 2.95% 04/31	USD	800,000	803,376	670,969	0.53%
TOTAL BERMUDA			803,376	670,969	0.53%
Kanada					
AIR CANADA 4.625% 08/29	CAD	100,000	79,580	68,153	0.05%
BROOKFIELD 4.7% 09/47	USD	200,000	227,961	167,552	0.13%
FAIRFAX 2.75% 03/28	EUR	150,000	179,865	147,318	0.12%
TOTAL CANADA			487,406	383,023	0.30%
Kajmany					
APIDOS CLO XV FLT 04/31	USD	1,100,000	1,100,781	1,092,345	0.87%
ATLAS SENIOR FLT 01/30	USD	825,157	825,322	819,704	0.65%
AVOLON 2.528% 11/27	USD	457,000	472,741	385,791	0.31%
KKR FINANCIAL FLT 04/29	USD	496,112	493,979	493,934	0.39%
SANDS CHINA 5.4% 08/28	USD	300,000	339,570	286,245	0.23%
WYNN MACAU 5.625% 08/28	USD	600,000	606,750	524,202	0.42%
TOTAL CAYMAN ISLANDS			3,839,143	3,602,221	2.87%
Francja					
ALTAREA SCA 1.875% 01/28	EUR	100,000	111,449	88,243	0.07%
ALTICE 4.25% 10/29	EUR	200,000	234,270	157,565	0.13%
ALTICE FRANCE 5.5% 10/29	USD	200,000	200,000	143,228	0.11%
BNP PARIBAS SA VAR 01/31	USD	400,000	416,884	341,852	0.27%
BNP PARIBAS SA VAR 09/28	USD	200,000	202,952	170,554	0.14%
BNP PARIBAS SA VAR 09/29	USD	400,000	400,000	333,501	0.27%
BPCE SA VAR 10/46	EUR	200,000	230,890	156,293	0.12%

Informacje dodatkowe stanowią integralną część niniejszych sprawozdań finansowych

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER GO DYNAMIC BOND

HOLDING 0.125% 09/25	EUR	100,000	117,907	98,549	0.08%
HOLDING 0.625% 09/28	EUR	200,000	235,802	178,679	0.14%
MUTUELLE VAR 06/52	EUR	200,000	240,754	150,806	0.12%
SOCIETE GENERALE SA VAR 12/64	USD	500,000	551,900	473,456	0.37%
TOTAL FRANCE			2,942,808	2,292,726	1.82%

Niemcy

DEUTSCHE 1.625% 01/27	EUR	100,000	110,683	96,949	0.08%
DEUTSCHE 2.625% 12/24	GBP	100,000	129,961	118,333	0.09%
DEUTSCHE BANK AG VAR 12/64	USD	200,000	200,056	160,580	0.13%
DEUTSCHE BANK VAR 01/32	USD	200,000	199,220	151,361	0.12%
DEUTSCHE BANK VAR 11/26	USD	200,000	203,733	178,036	0.14%
IHO 3.75% 09/26	EUR	200,000	248,402	204,129	0.16%
INEOS 2.25% 01/27	EUR	100,000	118,861	93,749	0.07%
VOLKSWAGEN 0.875% 02/25	GBP	100,000	136,503	115,777	0.09%
VOLKSWAGEN 1.875% 12/24	GBP	300,000	392,765	356,698	0.28%
ZF EUROPE 2% 02/26	EUR	300,000	358,015	298,496	0.24%
TOTAL GERMANY			2,098,199	1,774,108	1.40%

Hong Kong

HONG KONG

MELCO 5.375% 12/29	USD	200,000	200,000	166,165	0.13%
TOTAL HONG KONG			200,000	166,165	0.13%

Irlandia

AERCAP 3.3% 01/32	USD	400,000	398,496	327,432	0.26%
AVOLON 3.95% 07/24	USD	100,000	104,489	97,042	0.08%
BLACK DIAMOND FLT 01/32	EUR	1,422,430	1,720,785	1,534,832	1.22%
CARLYLE GLOBAL FLT 07/30	EUR	566,319	621,881	609,922	0.49%
DRYDEN 51 EURO FLT 07/31	EUR	486,816	534,339	525,557	0.42%
EURO-GALAXY VI FLT 04/31	EUR	788,531	860,780	843,162	0.67%
OAK HILL FLT 01/32	EUR	463,651	552,040	496,219	0.40%
PERRIGO 4.4% 06/30	USD	200,000	214,130	177,245	0.14%
TOTAL IRELAND			5,006,940	4,611,411	3.68%

Włochy

AMCO - ASSET 2.25% 07/27	EUR	100,000	113,685	99,177	0.08%
ATLANTIA 1.875% 02/28	EUR	600,000	719,557	559,725	0.45%
BANCA MONTE VAR 03/26	EUR	200,000	211,930	218,701	0.17%
INTESA 5.148% 06/30	GBP	100,000	125,965	102,870	0.08%
INTESA SANPAOLO SPA VAR 12/64	EUR	200,000	296,680	211,327	0.17%
UNICREDIT 7.83% 12/23	USD	400,000	471,100	402,405	0.32%
TOTAL ITALY			1,938,917	1,594,205	1.27%

Japonia

MIZUHO 2.564% 09/31	USD	500,000	500,000	393,840	0.31%
MIZUHO 3.477% 04/26	USD	200,000	210,460	189,429	0.15%
NISSAN 2.652% 03/26	EUR	100,000	130,860	102,108	0.08%
NISSAN 4.345% 09/27	USD	600,000	641,168	546,130	0.43%
NOMURA 3.103% 01/30	USD	900,000	952,513	768,000	0.61%
TOTAL JAPAN			2,435,001	1,999,507	1.58%

Informacje dodatkowe stanowią integralną część niniejszych sprawozdań finansowych

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER GO DYNAMIC BOND

Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2023 (c.d.)

Jersey

ATRIUM 2.625% 09/27	EUR	200,000	238,526	159,083	0.13%
GLOBALWORTH 2.95% 07/26	EUR	100,000	113,257	82,242	0.07%
TP ICAP 2.625% 11/28	GBP	200,000	267,950	187,580	0.15%
TOTAL JERSEY			619,733	428,905	0.35%

Luksemburg

ADLER GROUP 2.25% 04/27	EUR	300,000	356,478	116,739	0.09%
ALTICE 3% 01/28	EUR	100,000	97,489	84,717	0.07%
AROUNDTOWN 0.375% 04/27	EUR	600,000	663,350	471,041	0.38%
BEVCO LUX SARL 1% 01/30	EUR	600,000	723,760	510,856	0.41%
CPI 1.625% 04/27	EUR	150,000	163,186	119,688	0.10%
CPI PROPERTY 1.75% 01/30	EUR	200,000	221,966	132,440	0.11%
CPI PROPERTY 2.75% 05/26	EUR	300,000	397,766	266,756	0.21%
CROMWELL 2.125% 11/25	EUR	400,000	498,342	376,262	0.30%
JAB HOLDINGS 2.2% 11/30	USD	500,000	498,940	393,620	0.31%
TOTAL LUXEMBOURG			3,621,277	2,472,119	1.98%

Meksyk

PETROLEOS 10% 02/33	USD	100,000	97,700	91,687	0.07%
TOTAL MEXICO			97,700	91,687	0.07%

Korea Południowa

HYUNDAI 0.75% 09/23	USD	200,000	199,738	197,882	0.16%
TOTAL SOUTH KOREA			199,738	197,882	0.16%

Ponadnarodowy

DELTA AIR 4.5% 10/25	USD	83,336	83,336	81,554	0.06%
TOTAL SUPRANATIONAL			83,336	81,554	0.06%

Szwecja

BALDER FINLAND 1% 01/29	EUR	200,000	242,236	138,998	0.11%
SAGAX AB 2% 01/24	EUR	100,000	115,717	106,851	0.09%
SAGAX EURO 0.75% 01/28	EUR	100,000	120,683	82,729	0.07%
SAGAX EURO MTN 1% 05/29	EUR	300,000	360,526	233,539	0.19%
TOTAL SWEDEN			839,162	562,117	0.46%

Szwajcaria

CREDIT SUISSE GROUP VAR 12/64	USD	500,000	554,125	21,165	0.02%
UBS AG BOND 5.125% 05/24	USD	200,000	221,640	196,946	0.16%
TOTAL SWITZERLAND			775,765	218,111	0.18%

Holandia

CTP NV 0.625% 09/26	EUR	200,000	234,326	176,443	0.14%
CTP NV 1.25% 06/29	EUR	200,000	239,180	158,691	0.13%
CTP NV 1.5% 09/31	EUR	200,000	233,077	151,933	0.12%
ING GROEP NV VAR 12/64	USD	100,000	103,625	88,398	0.07%
PROSUS NV 3.68% 01/30	USD	100,000	100,000	84,949	0.07%
TOTAL THE NETHERLANDS			910,208	660,414	0.53%

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER GO DYNAMIC BOND

Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2023 (c.d.)

Wielka Brytania

BARCLAYS 4.375% 01/26	USD	400,000	456,358	384,444	0.31%
BARCLAYS PLC VAR 11/32	USD	300,000	300,000	236,313	0.19%
BARCLAYS PLC VAR 12/64	GBP	200,000	273,791	227,973	0.18%
BCP V 4.75% 11/28	EUR	400,000	462,420	373,067	0.30%
BELLIS 3.25% 02/26	GBP	400,000	553,800	426,858	0.34%
GSK 3.125% 03/25	USD	400,000	398,956	382,372	0.30%
HSBC 4.95% 03/30	USD	200,000	199,750	197,106	0.16%
HSBC HOLDINGS PLC VAR 12/64	USD	300,000	300,000	225,123	0.18%
HSBC HOLDINGS VAR 05/30	USD	200,000	213,292	179,781	0.14%
HSBC HOLDINGS VAR 06/31	USD	600,000	636,932	498,197	0.40%
HSBC HOLDINGS VAR 08/31	USD	300,000	309,030	239,640	0.19%
IMPERIAL 1.75% 03/33	EUR	400,000	472,484	316,167	0.25%
INEOS QUATTRO 2.5% 01/26	EUR	100,000	121,505	97,997	0.08%
LLOYDS BANKING GROUP VAR 12/64	USD	100,000	107,500	91,605	0.07%
LLOYDS BANKING VAR 08/26	USD	200,000	200,000	194,422	0.15%
MARKS & 3.75% 05/26	GBP	100,000	141,244	114,729	0.09%
NATIONWIDE 0.55% 01/24	USD	200,000	199,846	194,147	0.15%
NATIONWIDE BUILDING VAR 12/64	GBP	11,200	23,521	16,405	0.01%
NATIONWIDE VAR 08/24	USD	200,000	217,780	199,602	0.16%
NATWEST GROUP VAR 03/25	USD	600,000	655,421	589,514	0.47%
NATWEST GROUP VAR 05/29	USD	200,000	223,640	190,464	0.15%
SANTANDER UK VAR 11/28	USD	600,000	659,500	540,605	0.43%
STANDARD VAR 01/27	USD	200,000	200,000	177,440	0.14%
TESCO 0.375% 07/29	EUR	200,000	240,490	175,090	0.14%
VIRGIN MEDIA 4.25% 01/30	GBP	100,000	128,147	100,358	0.08%
VMED O2 UK 4.5% 07/31	GBP	400,000	556,680	387,162	0.31%
WORKSPACE 2.25% 03/28	GBP	200,000	279,358	186,488	0.15%
TOTAL UNITED KINGDOM			8,531,445	6,943,069	5.52%

Stany Zjednoczone

AAMES MORTGAGE FLT 04/36	USD	338,740	325,631	301,223	0.24%
ABFC 2005-WMC1 FLT 06/35	USD	114,472	112,684	110,186	0.09%
ABFC 2006-OPT2 FLT 10/36	USD	76,615	70,630	69,963	0.06%
ACE SECURITIES FLT 05/34	USD	40,814	39,896	43,013	0.03%
AEGIS ASSET FLT 10/35	USD	448,499	441,210	410,985	0.33%
AES CORP/THE 2.45% 01/31	USD	600,000	578,286	485,320	0.39%
ALASKA 4.8% 08/27	USD	241,209	259,474	232,032	0.18%
ALTERNATIVE 5.5% 03/36	USD	50,406	31,703	21,862	0.02%
ALTERNATIVE 6.5% 06/36	USD	1,157,424	684,353	588,095	0.47%
ALTERNATIVE FLT 09/47	USD	609,524	584,442	529,627	0.42%
ALTERNATIVE FLT 10/46	USD	93,058	87,183	85,021	0.07%
AMERICAN 0.4% 02/27	EUR	300,000	346,406	283,964	0.23%
AMERICAN 3% 10/28	USD	139,458	138,816	123,834	0.10%
AMERICAN 3.15% 02/32	USD	251,186	249,302	219,311	0.17%
AMERICAN 3.35% 10/29	USD	72,939	67,924	64,929	0.05%
AMERICAN 3.375% 02/31	USD	200,000	206,452	156,655	0.12%
AMERICAN 3.6% 09/27	USD	66,840	64,334	62,241	0.05%
AMERICAN HOME FLT 10/46	USD	89,522	83,991	76,316	0.06%

Informacje dodatkowe stanowią integralną część niniejszych sprawozdań finansowych

Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2023 (c.d.)

AMERIQUEST FLT 01/36	USD	600,000	594,750	559,036	0.45%
AMERIQUEST FLT 07/35	USD	100,000	95,375	93,144	0.07%
AMERIQUEST FLT 09/34	USD	317,837	317,738	308,334	0.25%
AMERIQUEST FLT 11/35	USD	92,166	90,669	89,721	0.07%
ANHEUSER-BUSC 4.35% 06/40	USD	100,000	99,937	92,061	0.07%
ARES FINANCE 3.25% 06/30	USD	100,000	99,771	84,275	0.07%
ARGENT FLT 11/34	USD	717,386	718,283	651,342	0.52%
ASSET BACKED FLT 02/35	USD	56,695	56,660	57,236	0.05%
ASSET BACKED FLT 07/35	USD	100,000	98,125	95,046	0.08%
AVIATION 4.125% 08/25	USD	100,000	108,384	93,462	0.07%
AVIATION 5.5% 12/24	USD	500,000	568,433	489,676	0.39%
BANK OF VAR 02/30	USD	100,000	109,161	92,668	0.07%
BANK OF VAR 03/32	USD	300,000	300,000	248,594	0.20%
BANK OF VAR 04/31	USD	200,000	212,460	168,007	0.13%
BANK OF VAR 04/32	USD	500,000	506,155	414,578	0.33%
BEAR STEARNS FLT 02/36	USD	393,865	390,911	392,626	0.31%
BEAR STEARNS FLT 02/37	USD	500,000	468,438	454,779	0.36%
BEAR STEARNS FLT 04/36	USD	66,852	65,515	66,445	0.05%
BEAR STEARNS FLT 07/34	USD	218,381	212,406	210,321	0.17%
BEAR STEARNS FLT 08/36	USD	132,787	130,935	131,684	0.10%
BEAR STEARNS FLT 10/35	USD	54,390	53,098	53,022	0.04%
BLUE OWL 3.125% 06/31	USD	300,000	296,190	228,567	0.18%
BROADCOM INC 2.6% 02/33	USD	700,000	697,116	547,546	0.44%
CAESARS 6.25% 07/25	USD	800,000	841,625	797,015	0.63%
CARLYLE 3.5% 09/29	USD	150,000	149,501	131,887	0.11%
CCO HOLDINGS 4.5% 08/30	USD	300,000	315,938	250,077	0.20%
CCO HOLDINGS 5% 02/28	USD	100,000	105,438	91,214	0.07%
CHARTER 3.9% 06/52	USD	900,000	873,321	589,750	0.47%
CHARTER 4.908% 07/25	USD	100,000	114,925	98,095	0.08%
CIT MORTGAGE FLT 10/37	USD	100,000	101,063	97,352	0.08%
CITIGROUP FLT 05/35	USD	100,000	98,750	91,170	0.07%
CITIGROUP FLT 07/45	USD	633,631	549,675	442,090	0.35%
CITIGROUP FLT 12/35	USD	97,270	87,446	92,005	0.07%
COTY INC/HFC 4.75% 01/29	USD	600,000	600,000	553,848	0.44%
CREDIT-BASED FLT 01/34	USD	138,535	134,942	132,883	0.11%
CWABS FLT 02/36	USD	515,467	497,748	482,225	0.38%
CWABS FLT 05/36	USD	55,192	53,813	54,232	0.04%
CWABS FLT 06/35	USD	107,424	98,696	93,605	0.07%
CWABS FLT 08/35	USD	600,000	599,250	551,436	0.44%
CWABS FLT 11/35	USD	499,546	499,234	485,781	0.39%
CWABS FLT 11/47	USD	138,284	132,600	152,603	0.12%
DELTA AIR LINES 7% 05/25	USD	400,000	452,500	408,818	0.33%
DEUTSCHE ALT-A FLT 12/36	USD	662,067	335,404	236,065	0.19%
DISH DBS 5.25% 12/26	USD	500,000	500,000	402,024	0.32%
EPR 4.5% 06/27	USD	50,000	53,960	44,911	0.04%
EQT CORP 6.625% 02/25	USD	56,000	56,000	55,736	0.04%
EXPEDIA 2.95% 03/31	USD	135,000	134,398	113,905	0.09%
EXPEDIA 6.25% 05/25	USD	176,000	196,722	176,669	0.14%

Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2023 (c.d.)

FAIR ISAAC CORP 4% 06/28	USD	100,000	100,000	91,831	0.07%
FIRST FRANKLIN FLT 01/35	USD	230,828	228,520	228,410	0.18%
FORD MOTOR 1.744% 07/24	EUR	100,000	108,485	105,616	0.08%
FORD MOTOR 2.33% 11/25	EUR	100,000	124,993	102,554	0.08%
FORD MOTOR 2.386% 02/26	EUR	100,000	124,993	102,546	0.08%
FORD MOTOR 3.25% 09/25	EUR	300,000	386,313	314,741	0.25%
FORD MOTOR 5.584% 03/24	USD	300,000	325,125	298,154	0.24%
FORD MOTOR FLT 12/24	EUR	100,000	113,701	107,791	0.09%
FREMONT HOME FLT 06/35	USD	1,013,000	990,849	897,467	0.71%
GOLDMAN SACHS VAR 03/27	USD	500,000	500,000	447,001	0.36%
GSAMP TRUST FLT 11/34	USD	81,113	78,376	76,494	0.06%
GSAMP TRUST FLT 11/35	USD	288,709	286,363	273,632	0.22%
GSAMP TRUST FLT 11/36	USD	208,383	113,048	100,962	0.08%
HOME EQUITY FLT 03/35	USD	700,000	694,750	677,423	0.54%
HOME EQUITY FLT 11/35	USD	700,000	695,188	656,660	0.52%
HSI ASSET FLT 04/37	USD	158,988	106,621	81,726	0.07%
HUDSON 3.25% 01/30	USD	150,000	149,577	95,081	0.08%
HYATT HOTELS 1.8% 10/24	USD	100,000	99,994	95,219	0.08%
INDYMAC INDX FLT 02/37	USD	310,849	241,685	199,393	0.16%
INDYMAC INDX FLT 07/36	USD	257,857	253,529	238,106	0.19%
INDYMAC INDX VAR 08/35	USD	377,623	354,774	290,190	0.23%
JPMORGAN CHASE VAR 02/26	USD	500,000	500,000	474,362	0.38%
JPMORGAN CHASE VAR 05/30	USD	150,000	161,069	137,600	0.11%
LEHMAN XS TRUST FLT 03/37	USD	43,198	42,230	42,657	0.03%
LEHMAN XS TRUST FLT 12/36	USD	67,821	66,294	65,776	0.05%
LIVE NATION 6.5% 05/27	USD	100,000	100,000	100,622	0.08%
LONG BEACH FLT 09/34	USD	243,172	235,572	231,464	0.18%
LONG BEACH FLT 09/36	USD	385,189	287,929	245,278	0.20%
MIDWEST 3.9% 04/24	USD	200,000	204,500	195,858	0.16%
MILEAGE PLUS 6.5% 06/27	USD	160,000	165,400	160,543	0.13%
MORGAN STANLEY FLT 01/35	USD	702,905	671,494	641,162	0.51%
MORGAN STANLEY FLT 02/37	USD	463,439	267,858	223,892	0.18%
MORGAN STANLEY FLT 03/36	USD	127,683	108,850	103,097	0.08%
MORGAN STANLEY FLT 09/33	USD	105,027	102,270	103,445	0.08%
MORGAN STANLEY FLT 10/36	USD	535,417	315,896	232,927	0.19%
MORGAN STANLEY VAR 08/36	USD	392,846	135,286	78,602	0.06%
NATIONAL 2.95% 03/31	USD	400,000	389,544	320,309	0.26%
NEW CENTURY FLT 09/35	USD	700,000	700,000	676,511	0.54%
NEW CENTURY FLT 11/34	USD	536,198	525,753	512,888	0.41%
NISSAN MOTOR 1.85% 09/26	USD	100,000	99,976	84,893	0.07%
NOVASTAR FLT 09/37	USD	66,736	64,707	66,004	0.05%
OMEGA 4.75% 01/28	USD	150,000	163,872	137,129	0.11%
ONEOK INC 6.35% 01/31	USD	100,000	99,667	103,050	0.08%
OPTION ONE FLT 02/35	USD	549,823	548,448	518,150	0.41%
OPTION ONE FLT 03/37	USD	509,434	471,864	457,449	0.36%
OPTION ONE FLT 04/37	USD	746,714	637,040	532,480	0.42%
OPTION ONE FLT 05/37	USD	229,804	171,347	135,558	0.11%
OPTION ONE FLT 12/35	USD	616,198	613,888	582,537	0.46%
ORGANON & 4.125% 04/28	USD	400,000	400,000	355,442	0.28%
OWNIT MORTGAGE FLT 09/37	USD	320,756	300,308	275,995	0.22%

Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2023 (c.d.)

PACIFIC GAS 3.25% 06/31	USD	400,000	399,152	325,607	0.26%
PACIFIC GAS 3.3% 08/40	USD	100,000	99,501	67,505	0.05%
PACIFIC GAS 3.75% 08/42	USD	100,000	103,500	69,298	0.06%
PACIFIC GAS 4.55% 07/30	USD	700,000	782,647	634,043	0.50%
PARK 4.875% 05/29	USD	400,000	400,000	345,110	0.27%
PENSKE TRUCK 4.45% 01/26	USD	200,000	229,382	191,658	0.15%
RALI SERIES FLT 01/37	USD	91,799	84,661	75,696	0.06%
RALI SERIES VAR 09/37	USD	106,517	76,959	78,101	0.06%
RAMP SERIES FLT 05/37	USD	109,023	97,731	95,378	0.08%
RENAISSANCE STEP 11/36	USD	1,281,274	659,856	470,979	0.38%
SAXON ASSET FLT 03/35	USD	111,280	101,891	101,345	0.08%
SAXON ASSET FLT 11/37	USD	621,095	610,225	588,635	0.47%
SAXON ASSET FLT 12/34	USD	476,088	469,839	400,168	0.32%
SECURITIZED FLT 07/36	USD	100,979	87,347	81,571	0.06%
SECURITIZED FLT 10/35	USD	475,672	475,077	447,178	0.36%
SOUNDVIEW HOME FLT 03/36	USD	668,677	668,677	651,778	0.52%
SOUNDVIEW HOME FLT 03/37	USD	82,537	76,760	76,819	0.06%
SOUNDVIEW HOME FLT 07/37	USD	390,503	361,459	320,774	0.26%
SOUNDVIEW HOME FLT 10/36	USD	78,799	74,268	73,575	0.06%
SOUTHERN 3.7% 04/30	USD	100,000	99,751	91,793	0.07%
SOUTHERN 3.7% 08/25	USD	200,000	213,530	192,605	0.15%
SPECIALTY FLT 11/37	USD	589,803	408,439	328,611	0.26%
SPIRIT 4.6% 06/28	USD	200,000	218,084	167,986	0.13%
STANDARD 2.25% 11/26	EUR	150,000	166,501	145,750	0.12%
STRUCTURED FLT 07/46	USD	92,696	77,361	77,174	0.06%
STRUCTURED FLT 09/36	USD	129,782	102,203	81,604	0.06%
SYNCHRONY 3.95% 12/27	USD	300,000	334,125	261,691	0.21%
SYNCHRONY 4.5% 07/25	USD	150,000	160,986	141,488	0.11%
SYSTEM 2.14% 12/25	USD	100,000	99,967	90,776	0.07%
TBA FNMA SINGLE 4.5%	USD	5,700,000	5,529,000	5,483,133	4.37%
TBA GNMA2 SINGLE 4%	USD	3,600,000	3,423,094	3,409,172	2.72%
TBA UMBS SINGLE 3.5% 08/52	USD	2,100,000	1,925,520	1,915,840	1.53%
TBA UMBS SINGLE FAMILY 3% 08/52	USD	3,200,000	2,831,500	2,820,875	2.25%
TBA UMBS SINGLE FAMILY 4%	USD	3,800,000	3,592,188	3,569,477	2.84%
TBA UMBS SINGLE FAMILY 5%	USD	4,900,000	4,836,641	4,804,680	3.83%
TD SYNEX 2.375% 08/28	USD	400,000	400,000	328,086	0.26%
TEGNA INC 4.625% 03/28	USD	100,000	100,000	88,625	0.07%
T-MOBILE USA 2.05% 02/28	USD	100,000	99,787	86,765	0.07%
T-MOBILE USA 2.25% 11/31	USD	200,000	197,366	160,123	0.13%
T-MOBILE USA 3.6% 11/60	USD	100,000	99,745	70,289	0.06%
UNITED 4.625% 04/29	USD	300,000	300,000	273,620	0.22%
UNITED 5.875% 10/27	USD	359,342	391,682	356,700	0.28%
US FOODS 4.625% 06/30	USD	300,000	300,000	269,173	0.21%
VICI 4.625% 06/25	USD	200,000	214,500	193,429	0.15%
WABTEC 1.25% 12/27	EUR	300,000	363,362	284,518	0.23%
WAMU FLT 04/37	USD	1,207,565	587,556	459,137	0.37%
WAMU MORTGAGE FLT 05/46	USD	20,519	18,364	19,183	0.02%
WAMU MORTGAGE VAR 09/36	USD	452,512	451,947	388,150	0.31%

Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2023 (c.d.)

WARNERMEDIA 3.638% 03/25	USD	200,000	200,000	193,014	0.15%
WELLS FARGO & VAR 04/31	USD	700,000	845,579	665,833	0.53%
WELLS FARGO FLT 04/37	USD	1,556,008	1,360,681	1,200,643	0.95%
WMG 2.25% 08/31	EUR	400,000	473,540	347,544	0.28%
WPC EUROBOND 1.35% 04/28	EUR	200,000	220,388	185,677	0.15%
TOTAL UNITED STATES OF AMERICA			69,376,441	63,637,202	50.67%
Obligacje razem			105,465,258	92,931,398	73.99%
Obligacje skarbowe					
Republika Dominikany					
DOMINICAN REPUBLIC 5.3% 01/41	USD	150,000	150,000	117,896	0.09%
TOTAL DOMINICAN REPUBLIC			150,000	117,896	0.09%
Węgry					
NATIONAL BK HUNGARY BILL	HUF	514,000,000	1,504,102	1,502,892	1.20%
TOTAL HUNGARY			1,504,102	1,502,892	1.20%
Japonia					
JAPAN BILL ZERO 08/23	JPY	907,000,000	6,458,876	6,276,887	5.00%
TOTAL JAPAN			6,458,876	6,276,887	5.00%
Meksyk					
UNITED 6.35% 02/35	USD	200,000	199,264	210,758	0.17%
TOTAL MEXICO			199,264	210,758	0.17%
Rumunia					
ROMANIA 1.75% 07/30	EUR	400,000	471,744	333,634	0.27%
TOTAL ROMANIA			471,744	333,634	0.27%
Afryka Południowa					
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 10.5% 12/26	ZAR	47,000,000	3,555,901	2,586,757	2.06%
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 4.85% 09/29	USD	400,000	412,680	352,639	0.28%
TOTAL SOUTH AFRICA			3,968,581	2,939,396	2.34%
Turcja					
REPUBLIC OF TURKEY 6.35% 08/24	USD	250,000	261,750	246,157	0.20%
TOTAL TURKEY			261,750	246,157	0.20%
Stany Zjednoczone					
GOLDEN ST 2.587% 06/29	USD	400,000	400,000	342,305	0.27%
GOLDEN ST 2.746% 06/34	USD	200,000	200,000	163,135	0.13%
TOBACCO 3.401% 06/34	USD	100,000	100,000	81,688	0.07%
UNITED 0.375% 04/25	USD	300,000	300,469	276,082	0.22%
UNITED 0.375% 11/25	USD	1,700,000	1,622,197	1,534,881	1.22%
UNITED 1.875% 02/41	USD	5,600,000	4,445,017	4,071,156	3.24%
UNITED STATES 1.5% 10/24	USD	1,100,000	1,076,547	1,046,891	0.83%
UNITED STATES 2% 06/24	USD	4,500,000	4,406,769	4,351,850	3.47%
TOTAL UNITED STATES OF AMERICA			12,550,999	11,867,988	9.45%

Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2023 (c.d.)

Obligacje skarbowe razem

<u>25,565,316</u>	<u>23,495,608</u>	<u>18.72%</u>
<u>131,030,574</u>	<u>116,427,006</u>	<u>92.71%</u>

Zbywalne papiery wartościowe dopuszczone do oficjalnego notowania na giełdzie lub znajdujące się w obrocie na innym rynku regulowanym

Fundusze inwestycyjne***Irlandia***

PIMCO SELECT FUNDS PLC

USD 1,209,413 12,035,440 12,043,345 9.59%

Irlandia razem

12,035,440 12,043,345 9.59%

Fundusze inwestycyjne razem

12,035,440 12,043,345 9.59%

Inwestycje ogółem

143,066,014 128,470,351 102.30%

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Klasyfikacja geograficzna inwestycji na dzień 30 czerwca 2023 r.

	% WAN
Stany Zjednoczone	60.12%
Irlandia	13.27%
Japonia	6.58%
Wielka Brytania	5.52%
Kajmany	2.87%
Afryka Południowa	2.34%
Luksemburg	1.98%
Francja	1.82%
Niemcy	1.40%
Włochy	1.27%
Węgry	1.20%
Bermudy	0.53%
Holandia	0.53%
Szwecja	0.46%
Jersey	0.35%
Kanada	0.30%
Rumunia	0.27%
Australia	0.26%
Meksyk	0.24%
Turcja	0.20%
Szwajcaria	0.18%
Austria	0.17%
Korea Południowa	0.16%
Hong Kong	0.13%
Republika Dominikany	0.09%
Ponadnarodowe	0.06%
Razem	102.30%

Ekonomiczna klasyfikacja inwestycji na dzień 30 czerwca 2023 r.

	% WAN
Różne	17.95%
Kredyty hipoteczne	16.49%
Listy zastawne UMBS TBA	10.45%
Fundusze inwestycyjne otwarte	9.59%
Opłaty skarbowe	6.20%
Oferty prywatna	6.04%
Noty skarbowe	5.74%
Bankowość i finanse	5.37%
Zabezpieczone zobowiązanie kredytowe (CLO)	5.11%
Listy zastawne FNMA TBA ARM	4.37%
Obligacje skarbowe	3.24%
Dług państwowy	3.07%
Listy zastawne GNMA II TBA	2.72%
Organizacje pozarządowe	2.38%
Usługi komunalne	1.77%
Leasing sprzętu	0.66%
Przemysłowe	0.47%
Inne	0.17%
Pozarządowe	0.05%
Razem	102.30%

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER FUTURE WEALTH

Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2023 r.

Opis	Waluta	Ilość	Koszt USD	Wartość rynkowa USD	% WAN
Fundusze inwestycyjne					
Francja					
LYXOR NEW ENERGY DR TOTAL FRANCE	EUR	83,389	3,519,299	3,167,833	3.23%
Francja razem			3,519,299	3,167,833	3.23%
Irlandia					
ISHARES DIGITALISATION	USD	478,823	4,086,346	3,670,178	3.75%
ISHARES ELECTRIC	USD	500,776	3,668,190	3,830,689	3.91%
ISHARES S&P 500 HEALTH	USD	318,034	3,146,942	3,256,668	3.32%
KBI GLOBAL SUSTN INFR-AD	USD	327,382	3,270,230	3,348,136	3.42%
L&G CYBER SECURITY UCITS	GBP	174,023	3,802,400	3,616,198	3.69%
NEUBERGER BERMAN	EUR	307,160	4,111,913	3,729,792	3.81%
SPDR MSCI EUROPE HEALTH	EUR	16,657	3,341,538	3,621,110	3.70%
WELLINGTON FINTECH FUND	EUR	141,022	2,212,820	1,787,755	1.82%
Irlandia razem			27,640,379	26,860,526	27.42%
Luksemburg					
ALLIANZ GLOBAL	EUR	1,520	3,733,280	3,747,604	3.82%
AXA WORLD FUNDS -	USD	15,288	3,541,418	3,543,188	3.62%
BELLEVUE FUNDS LUX	USD	18,143	3,589,281	3,825,210	3.90%
BNP PARIBAS EASY ECPI	EUR	187,877	3,092,448	3,448,889	3.52%
BNP PARIBAS FUNDS	EUR	11,313	1,776,193	1,708,673	1.74%
BNP PARIBAS FUNDS - AQUA	EUR	8,342	2,996,572	2,999,050	3.06%
BNP PARIBAS FUNDS ENERGY	EUR	3,762	4,352,701	3,672,701	3.75%
CPR INVEST - GLOBAL	EUR	21	3,882,672	3,601,803	3.68%
DWS INVEST GLOBAL	EUR	12,115	1,722,583	1,713,492	1.75%
EDMOND DE ROTHSCHILD	EUR	27,692	3,349,035	3,596,374	3.67%
GAM MULTISTOCK - LUXURY	USD	19,894	3,057,131	3,017,740	3.08%
GOLDMAN SACHS SICAV -	USD	143,310	4,088,205	3,631,486	3.71%
INVESCO ASIA CONSUMER	USD	214,560	4,381,643	3,482,299	3.55%
JPMORGAN FUNDS -	USD	42,910	4,009,589	3,139,375	3.20%
LYXOR MSCI WORLD	USD	6,026	3,201,119	3,759,501	3.84%
NINETY ONE GLOBAL	USD	74,778	1,505,555	1,511,260	1.54%
NINETY ONE GLOBAL	EUR	38,625	3,229,890	3,140,657	3.21%
NORDEA 1 SICAV - GLOBAL	EUR	26,638	1,019,660	984,103	1.00%
PICTET - SECURITY	EUR	10,246	4,240,172	3,640,781	3.72%
ROBECO CAPITAL GROWTH	USD	9,962	1,767,191	1,751,180	1.79%
ROBECO CAPITAL GROWTH	EUR	10,806	3,630,909	3,260,837	3.33%
TEMPLETON GLOBAL CLIMATE	EUR	131,725	1,452,759	1,467,299	1.50%
Luksemburg razem			67,620,006	64,643,502	65.98%
Fundusze inwestycyjne ogółem			98,779,684	94,671,861	96.63%
Inwestycje ogółem			98,779,684	94,671,861	96.63%

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2023 roku

SANTANDER FUTURE WEALTH

Klasyfikacja geograficzna inwestycji na dzień 30 czerwca 2023 r.

	% WAN
Luksemburg	65.98%
Irlandia	27.42%
Francja	3.23%
Razem	96.63%

Ekonomiczna klasyfikacja inwestycji na dzień 30 czerwca 2023 r.

	% WAN
Fundusze inwestycyjne otwarte	67.67%
ETF	28.96%
Total	96.63%

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2023 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 2021 roku, a zmiany zostały opublikowane w Elektronicznym rejestrze firm i stowarzyszeń (RESA) (RESA_2021_203) w dniu 23 sierpnia 2021 roku.

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

Spółka SICAV jest zarejestrowana w Luksemburskim Rejestrze Działalności Handlowej i Spółek (*Registre de Commerce et des Sociétés*) pod numerem B 45.337. Rok finansowy spółki SICAV kończy się w dniu 31 grudnia każdego roku.

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

W dniu 3 lutego 2023 roku Rada Dyrektorów SICAV podjęła decyzję o uruchomieniu Subfunduszu SANTANDER TARGET MATURITY 2026 EURO z datą wejścia w życie 21 marca 2023 roku.

W dniu 3 lutego 2023 roku Rada Dyrektorów SICAV podjęła decyzję o uruchomieniu Subfunduszu SANTANDER TARGET MATURITY 2026 dollar z datą wejścia w życie 28 marca 2023 roku.

W dniu 23 maja 2023 roku Rada Dyrektorów SICAV podjęła decyzję o uruchomieniu Subfunduszu SANTANDER GO ASIAN EQUITY z datą wejścia w życie 27 czerwca 2023 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 denominowana 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

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2023 roku

wartości 500 EUR, 500 USD lub 1 000 GBP, zgodnie z walutą referencyjną Subfunduszu.

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

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2023 roku

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 2023 roku, oferta obejmowała emisję i sprzedaż Tytułów Uczestnictwa następujących Subfunduszy:

- SANTANDER GO SHORT DURATION DOLLAR (denominowany w USD)

- *Klasa A
- *Klasa B
- *Klasa BE (denominowana w EUR)
- *Klasa I
- *Klasa S

- SANTANDER LATIN AMERICAN CORPORATE BOND (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)
- *Klasa RKP (denominowana w GBP)
- *Klasa V

- SANTANDER GO NORTH AMERICAN EQUITY (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 EUROPEAN DIVIDEND (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 2023 roku

- SANTANDER AM LATIN AMERICAN FIXED INCOME (denominowany w USD)
 - *Klasa A
 - *Klasa AE (denominowana w EUR)
 - *Klasa B
 - *Klasa D
 - *Klasa I

 - SANTANDER AM EURO CORPORATE BOND (denominowany w EUR)
 - *Klasa A
 - *Klasa AD
 - *Klasa B
 - *Klasa BD
 - *Klasa I

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

 - SANTANDER AM LATIN AMERICAN EQUITY OPPORTUNITIES (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 ACTIVE PORTFOLIO 1 (denominowany w USD)
 - *Klasa A
 - *Klasa AE (denominowana w EUR)
 - *Klasa B

 - SANTANDER ACTIVE PORTFOLIO 2 (denominowany w USD)
 - *Klasa A
 - *Klasa AE (denominowana w EUR)
 - *Klasa B

 - SANTANDER CORPORATE COUPON (denominowany w USD)
 - *Klasa AD
 - *Klasa CD
 - *Klasa CDE (denominowana w EUR)
 - *Klasa ID

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

 - SANTANDER SELECT MODERATE (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 2023 roku

- SANTANDER SELECT DYNAMIC (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 GLOBAL EQUITY ESG (denominowany w USD)

*Klasa A

*Klasa AE (denominowana w EUR)

*Klasa AEH (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 2023 roku

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

- *Klasa A
- *Klasa I
- *Klasa M

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)

- *Klasa AE (deminowana w EUR)
- *Klasa I
- *Klasa IEH (deminowana w EUR)
- *Klasa M (utworzona 24 stycznia 2023 r.)

SANTANDER PROSPERITY (denominowany w USD)

- *Klasa A
- *Klasa AE (deminowana w EUR)
- *Klasa AEH (deminowana w EUR)
- *Klasa I
- *Klasa IE (deminowana w EUR)
- *Klasa RKP (deminowana w GBP)

SANTANDER TARGET MATURITY 2026 EURO (denominowany w EUR)(utworzony 21 marca 2023 r.)

- *Klasa A
- *Klasa AD

SANTANDER TARGET MATURITY 2026 DOLLAR(denominowany w USD)(utworzony 28 marca 2023 r.)

- *Klasa A
- *Klasa AD

SANTANDER GO ASIAN EQUITY (denominowany w USD)(utworzony 27 czerwca 2023 r.)

- *Klasa A
- *Klasa AE (deminowana w EUR)
- *Klasa AE (deminowana w EUR)
- *Klasa I

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.

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2023 roku

Nota 2 – Dystrybucja dywidendy

Rada Dyrektorów SICAV postanowiła w dniu 13 czerwca 2023 roku o wypłaceniu w dniu 29 czerwca 2023 roku zaliczki na poczet dywidendy w następującej wysokości:

- SANTANDER LATIN AMERICAN CORPORATE BOND
*Klasa AD: 2.163745 USD

- SANTANDER AM LATIN AMERICAN FIXED INCOME
*Klasa D: 1.264126 USD

- SANTANDER CORPORATE COUPON
*Klasa AD: 1.468445 USD
*Klasa CD: 1.525294 USD
*Klasa CDE: 1.771552 EUR
*Klasa ID: 1,520732 USD

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

- 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 2023 roku są równe łącznej sumie odpowiednich pozycji sprawozdań finansowych każdego z Subfunduszy, przeliczonych na EUR według kursu wymiany obowiązującego na dzień 30 czerwca 2023 roku.

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2023 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 2023 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 pod nagłówkiem „operacje walutowe”.

Kursy głównych walut obowiązujące na dzień 30 czerwca 2023 roku:

1 EUR = 0.858929 GBP

1 EUR = 1.092000 USD

3.4 Wycena kontraktów walutowych forward

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

3.5 Wycena kontraktów terminowych futures

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

3.6 Wycena opcji

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 wymiennalna.

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 w zamian otrzymuje regularny strumień płatności. Całkowite wyniki będą obejmować zyski i straty z tytułu instrumentu bazowego, a także wszelkie odsetki

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2023 roku

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 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 narostymi odsetkami stanowi przybliżoną wartość, za jaką papiery wartościowe zostaną odkupione przez kontrahenta.

3.11 Koszty organizacyjne

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

3.12 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.

3.13 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.

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 SHORT DURATION DOLLAR,
 - SANTANDER LATIN AMERICAN CORPORATE BOND,
 - SANTANDER GO NORTH AMERICAN EQUITY,
 - SANTANDER EUROPEAN DIVIDEND,
 - SANTANDER AM EURO CORPORATE BOND,
 - SANTANDER AM EURO EQUITY,
 - SANTANDER AM LATIN AMERICAN EQUITY OPPORTUNITIES,
 - SANTANDER SELECT DEFENSIVE,
 - SANTANDER SELECT MODERATE,
 - SANTANDER SELECT DYNAMIC,
 - SANTANDER MULTI INDEX SUBSTANCE,
 - SANTANDER MULTI INDEX BALANCE,
 - SANTANDER MULTI INDEX AMBITION,
 - SANTANDER SELECT INCOME,
 - SANTANDER GO ABSOLUTE RETURN,
 - SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG,
 - SANTANDER COVERED BOND,
 - SANTANDER GO DYNAMIC BOND,
-

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2023 roku

- SANTANDER LATIN AMERICAN INVESTMENT GRADE ESG BOND,
- SANTANDER FUTURE WEALTH,
- SANTANDER GO GLOBAL HIGH YIELD BOND
- SANTANDER PROSPERITY
- SANTANDER TARGET MATURITY 2026 EURO (utworzony 21 marca 2023 r.)
- SANTANDER TARGET MATURITY 2026 DOLLAR (utworzony 28 marca 2023 r.).
- SANTANDER GO ASIAN EQUITY (utworzony 27 czerwca 2023 r.).

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

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

- SANTANDER GO SHORT DURATION DOLLAR,
- SANTANDER LATIN AMERICAN CORPORATE BOND,
- SANTANDER GO NORTH AMERICAN EQUITY,
- SANTANDER EUROPEAN DIVIDEND,
- SANTANDER AM LATIN AMERICAN FIXED INCOME,
- SANTANDER AM EURO CORPORATE BOND,
- SANTANDER AM EURO EQUITY,
- SANTANDER AM LATIN AMERICAN EQUITY OPPORTUNITIES,
- SANTANDER SELECT DEFENSIVE,
- SANTANDER SELECT MODERATE,
- SANTANDER SELECT DYNAMIC,
- 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 GLOBAL EQUITY ESG,
- SANTANDER COVERED BOND,
- SANTANDER GO DYNAMIC BOND,
- SANTANDER LATIN AMERICAN INVESTMENT GRADE ESG BOND,
- SANTANDER FUTURE WEALTH,
- SANTANDER GO GLOBAL HIGH YIELD BOND
- SANTANDER PROSPERITY
- SANTANDER TARGET MATURITY 2026 EURO (utworzony 21 marca 2023 r.)
- SANTANDER TARGET MATURITY 2026 DOLLAR (utworzony 28 marca 2023 r.).
- SANTANDER GO ASIAN EQUITY (utworzony 27 czerwca 2023 r.)..

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

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 SHORT DURATION DOLLAR

- 0.70% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy A
-

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2023 roku

- 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 LATIN AMERICAN CORPORATE BOND

- 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
- 0.60% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy RKP
- 0.34% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy V

SANTANDER GO NORTH AMERICAN EQUITY

- 2.00% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy A
- 1.30% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy B i 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 i ME
- 0.60% za Tytuły Uczestnictwa Klasy RKP
- 0.53% za Tytuły Uczestnictwa Klasy SE
- 0.45% za Tytuły Uczestnictwa Klasy V

SANTANDER EUROPEAN DIVIDEND

- 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 LATIN AMERICAN FIXED INCOME

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

SANTANDER AM EURO CORPORATE BOND

- 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 EURO EQUITY

- 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 LATIN AMERICAN EQUITY OPPORTUNITIES

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

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2023 roku

- 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

SANTANDER ACTIVE PORTFOLIO 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 ACTIVE PORTFOLIO 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 CORPORATE COUPON

- 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

SANTANDER SELECT DEFENSIVE

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

SANTANDER SELECT MODERATE

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

SANTANDER SELECT DYNAMIC

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

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 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 GLOBAL EQUITY ESG

- 1.60% za Tytuły Uczestnictwa Klasy A
 - 1.60% za Tytuły Uczestnictwa Klasy AE
-

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2023 roku

- 1.60% za Tytuły Uczestnictwa Klasy AEH
- 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
- 0.05% za Tytuły Uczestnictwa Klasy M

SANTANDER FUTURE WEALTH

- 1.35% za Tytuły Uczestnictwa Klasy A, Klasy AE, Klasy AEH i Klasy APH
- 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 GO GLOBAL HIGH YIELD BOND

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

SANTANDER PROSPERITY

- 1.25% za Tytuły Uczestnictwa Klasy A, Klasy AE i Klasy AEH
- 0.50% za Tytuły Uczestnictwa Klasy I i Klasy IE
- 0.50% za Tytuły Uczestnictwa Klasy RKP

SANTANDER TARGET MATURITY 2026 EURO (utworzony 21 marca 2023 r.)

- 1.00% za Tytuły Uczestnictwa Klasy A i Klasy AD

SANTANDER TARGET MATURITY 2026 DOLLAR (utworzony 28 marca 2023 r.)

- 1.00% za Tytuły Uczestnictwa Klasy A i Klasy AD

SANTANDER GO ASIAN EQUITY (utworzony 27 czerwca 2023 r.)

- 1.40% za Tytuły Uczestnictwa Klasy A, Klasy AE i Klasy AEH
 - 0.60% za Tytuły Uczestnictwa Klasy I
-

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2023 roku

Nota 6 - Zobowiązania z tytułu podatków i inne koszty

	SANTANDER GO NORTH AMERICAN EQUITY	SANTANDER AM EURO EQUITY
Koszty administracyjne (Nota 7)	174,292	107,860
Podatek roczny (Nota 8)	31,737	15,657
Koszty audytu i prawne	3,734	30,583
Opłaty na rzecz depozytariusza (Nota 7)	24,472	42,162
Opłaty za zarządzanie (Nota 5)	368,341	93,522
Inne opłaty	136,793	229,291
	<hr/>	<hr/>
	739,369	519,075

	SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG	SANTANDER GO DYNAMIC BOND
Koszty administracyjne (Nota 7)	137,042	95,196
Podatek roczny (Nota 8)	41,243	8,720
Koszty audytu i prawne	7,186	3,752
Opłaty na rzecz depozytariusza (Nota 7)	15,215	34,610
Opłaty za zarządzanie (Nota 5)	398,873	82,875
Inne opłaty	111,081	52,547
	<hr/>	<hr/>
	710,640	277,700

	SANTANDER FUTURE WEALTH
Koszty administracyjne (Nota 7)	41,277
Podatek roczny (Nota 8)	7,421
Koszty audytu i prawne	3,340
Opłaty na rzecz depozytariusza (Nota 7)	4,709
Opłaty za zarządzanie (Nota 5)	63,830
Inne opłaty	34,525
	<hr/>
	155,102

Nota nr 7 – Depozytariusz i koszty administracyjne

Jako Depozytariusz oraz Agent Administracyjny, Korporacyjny i Domicylacyjny J.P. MORGAN SE, Oddział w Luksemburgu 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. jako wynagrodzenie za prowadzenie księgowości funduszu, wycenę i usługi powiernicze w przypadku gdy stawki opłat za te usługi (wyrażone w punktach bazowych rocznie) nie osiągną minimum rocznego. Opłaty administracyjne i powiernicze (stawka wyrażona w punktach bazowych z minimum rocznym) są kalkulowane i naliczane w Subfunduszach w trybie dziennym i płatne na rzecz Depozytariusza oraz 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

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2023 roku

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 2023 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 SHORT DURATION DOLLAR	USD	-	-	-
SANTANDER LATIN AMERICAN CORPORATE BOND	USD	-	-	-
SANTANDER GO NORTH AMERICAN EQUITY	USD	-	-	-
SANTANDER EUROPEAN DIVIDEND	EUR	6,693	-	6,693
SANTANDER AM LATIN AMERICAN FIXED INCOME	USD	302	-	302
SANTANDER AM EURO CORPORATE BOND	EUR	471	-	471
SANTANDER AM EURO EQUITY	EUR	64,912	-	64,912
SANTANDER AM LATIN AMERICAN EQUITY OPPORTUNITIES	USD	5,440	-	5,440
SANTANDER ACTIVE PORTFOLIO 1	USD	2,496	-	2,496
SANTANDER ACTIVE PORTFOLIO 2	USD	1,727	-	1,727
SANTANDER CORPORATE COUPON	USD	1,203	-	1,203
SANTANDER SELECT DEFENSIVE	EUR	26,697	-	26,697
SANTANDER SELECT MODERATE	EUR	10,926	-	10,926
SANTANDER SELECT DYNAMIC	EUR	19,358	-	19,358
SANTANDER MULTI INDEX SUBSTANCE	EUR	-	-	-
SANTANDER MULTI INDEX BALANCE	EUR	-	-	-
SANTANDER MULTI INDEX AMBITION	EUR	-	-	-
SANTANDER SELECT INCOME	EUR	14,369	-	14,369
SANTANDER GO ABSOLUTE RETURN	EUR	-	-	-
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG	USD	-	-	-
SANTANDER COVERED BOND	EUR	156	-	156
SANTANDER GO DYNAMIC BOND	USD	-	-	-
SANTANDER LATIN AMERICAN INVESTMENT GRADE ESG BOND	USD	-	-	-
SANTANDER FUTURE WEALTH	USD	1,583	-	1,583
SANTANDER GO GLOBAL HIGH YIELD BOND	USD	-	-	-
SANTANDER PROSPERITY	USD	-	-	-
SANTANDER TARGET MATURITY 2026 EURO	EUR	-	-	-
SANTANDER TARGET MATURITY 2026 DOLLAR	USD	-	-	-
SANTANDER GO ASIAN EQUITY	USD	-	-	-

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2023 roku

W przypadku dłużnych papierów wartościowych, koszty transakcji nie są ujmowane oddzielnie od ceny zakupu papieru wartościowego i dlatego nie mogą być ujawniane oddzielnie. Prowizje od instrumentów pochodnych są uwzględniane bezpośrednio w cenie transakcji.

Nota 11 – Terminowe kontrakty walutowe

Na dzień 30 czerwca 2023 roku, Subfundusz SANTANDER GO NORTH AMERICAN EQUITY miał zawarte następujące terminowe kontrakty walutowe:

	Kupiona ilość		Sprzedana ilość	Data zapadalności	Niezrealizowane USD	Druga strona kontraktu
BRL	4,460,503	USD	(931,693)	31/07/2023	(11,737)	JPMorgan Chase & Co.
BRL	78,328,104	USD	(16,333,668)	31/07/2023	(179,829)	JPMorgan Chase & Co.
BLR	480,444	USD	(100,000)	31/07/2023	(917)	JPMorgan Chase & Co.
BLR	3.002.236	USD	(615,401)	31/07/2023	3,759	JPMorgan Chase & Co.
EUR	36.870,480	USD	(40,641,368)	31/07/2023	(357,381)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	93.310	USD	(102,433)	31/07/2023	(485)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	12,000	USD	(13,160)	31/07/2023	(49)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	25,430	USD	(27,758)	31/07/2023	26	JPMorgan Chase & Co.
USD	1,552,697	BRL	(1,410,443)	31/07/2023	11,674	JPMorgan Chase & Co.
			Razem		(534,939)	

Na dzień 30 czerwca 2023 roku, Subfundusz SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG miał zawarte następujące terminowe kontrakty walutowe:

	Kupiona ilość		Sprzedana ilość	Data zapadalności	Niezrealizowane USD	Druga strona kontraktu
BRL	325,073,954	USD	(67,787,291)	31/07/2023	(746,317)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	28,304	USD	(31,148)	31/07/2023	(223)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	963,433	USD	(1,060,603)	31/07/2023	(7,974)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	36,684,305	USD	(40,436,152)	31/07/2023	(355,577)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	155,747	USD	(171,064)	31/07/2023	(898)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	888	USD	(978)	31/07/2023	(9)	JPMorgan Chase & Co.
USD	10,929	EUR	(10,000)	31/07/2023	3	JPMorgan Chase & Co.
USD	202,933	EUR	(185,840)	31/07/2023	(112)	JPMorgan Chase & Co.
USD	93,101	EUR	(85,000)	31/07/2023	232	JPMorgan Chase & Co.
USD	98,197	EUR	(90,000)	31/07/2023	(135)	JPMorgan Chase & Co.
USD	194,000	BRL	(932,061)	31/07/2023	1,778	JPMorgan Chase & Co.
USD	1,715,810	BRL	(8,204,145)	31/07/2023	23,845	JPMorgan Chase & Co.
USD	462,000	BRL	(2,228,365)	31/07/2023	2,438	JPMorgan Chase & Co.
USD	391,000	BRL	(1,902,841)	31/07/2023	(1,429)	JPMorgan Chase & Co.
			Razem		(1,084,378)	

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2023 roku

Na dzień 30 czerwca 2023 roku, Subfundusz SANTANDER GO DYNAMIC BOND miał zawarte następujące terminowe kontrakty walutowe:

	Kupiona ilość		Sprzedana ilość	Data zapadalności	Niezrealizowane USD	Druga strona kontraktu
AUD	923,000	USD	(623,923)	16/08/2023	(8,727)	Bank of America
BRL	5,209,861	USD	(967,243)	05/07/2023	112,547	Goldman Sachs Bank USA
BRL	5,284,331	USD	(1,082,411)	05/09/2023	295	Goldman Sachs Bank USA
BRL	16,561	USD	(3,436)	05/07/2023	(4)	Goldman Sachs Bank USA
CLP	3,841,113,359	USD	(4,786,136)	07/08/2023	(20,770)	Toronto Dominion Bank
CLP	104,947,872	USD	(130,573)	03/07/2023	260	State Street Bank International
COP	676,899,918	USD	(158,887)	16/08/2023	1,049	Barclays London
EUR	75,000	USD	(81,336)	16/08/2023	672	MS (FX OPS) London
EUR	67,000	USD	(71,905)	16/08/2023	1,356	Barclays London
EUR	79,000	USD	(86,453)	16/08/2023	(70)	BNP Paribas S.A.
EUR	221,976	USD	(241,699)	05/07/2023	489	JPMorgan Chase & Co.
EUR	32,305,067	USD	(35,609,032)	31/07/2023	(313,129)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	90,368	USD	(98,641)	31/07/2023	94	JPMorgan Chase & Co.
EUR	1,386,629	USD	(1,528,445)	31/07/2023	(13,440)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	29,920,234	USD	(32,980,293)	31/07/2023	(290,014)	JPMorgan Chase & Co.
GBP	117,000	USD	(145,967)	16/08/2023	2,817	Barclays London
INR	25,905,505	USD	(313,118)	20/09/2023	1,739	Bank of America
INR	26,110,045	USD	(315,830)	20/09/2023	1,513	UBS AG
INR	1,693,989	USD	(20,560)	20/09/2023	29	Bank of America
JPY	155,402,243	USD	(1,169,397)	16/08/2023	(86,712)	MS (FX OPS) London
JPY	71,572,288	USD	(539,765)	16/08/2023	(41,122)	Toronto Dominion Bank
JPY	10,852,398	USD	(82,002)	16/08/2023	(6,394)	Barclays London
JPY	1,783,548	USD	(13,426)	16/08/2023	(1,000)	JP Morgan Securities Plc
JPY	27,600,000	USD	(202,757)	16/08/2023	(10,469)	Standard Chartered Bank London
MXN	3,774	USD	(196)	14/07/2023	23	Royal Bank Of Canada, Toronto
MXN	7,091,377	USD	(385,192)	18/07/2023	27,097	Bank of America
MXN	5,464,304	USD	(311,215)	16/10/2023	1,072	JP Morgan Securities Plc
MXN	11,048,000	USD	(637,360)	16/08/2023	1,209	MS (FX OPS) London
PEN	320,800	USD	(87,483)	12/07/2023	945	Bank of America
PEN	130,093	USD	(35,467)	13/09/2023	217	Standard Chartered Bank Plc
PEN	118,767	USD	(32,459)	13/09/2023	119	JPMorgan Chase & Co.
PEN	595,341	USD	(163,000)	20/09/2023	225	JPMorgan Chase & Co.
PEN	321,814	USD	(88,192)	14/08/2023	256	Goldman Sachs Bank USA
PLN	114,000	USD	(26,513)	21/07/2023	1,519	Goldman Sachs Bank USA
PLN	92,000	USD	(21,690)	21/07/2023	932	BNP Paribas S.A.
PLN	80,000	USD	(18,939)	21/07/2023	732	Morgan Stanley & Co. Incorporated
PLN	58,000	USD	(14,013)	21/07/2023	249	Morgan Stanley & Co. Incorporated
PLN	90,000	USD	(21,608)	21/07/2023	522	Morgan Stanley & Co. Incorporated
PLN	94,000	USD	(22,283)	21/07/2023	831	Morgan Stanley & Co. Incorporated
PLN	87,000	USD	(20,530)	21/07/2023	863	Bank of America
PLN	44,000	USD	(10,638)	21/07/2023	182	Morgan Stanley & Co. Incorporated
PLN	52,000	USD	(12,586)	21/07/2023	201	Morgan Stanley & Co. Incorporated
PLN	100,000	USD	(24,500)	21/07/2023	89	UBS AG
USD	4,618,328	CLP	(3,755,485,861)	27/07/2023	(47,998)	State Street Bank International
USD	308,519	ZAR	(5,749,631)	17/10/2023	7,423	Goldman Sachs Bank USA
USD	2,048,964	PLN	(8,823,637)	21/07/2023	(120,729)	BNP Paribas S.A.
USD	44,967	PLN	(194,000)	21/07/2023	(2,736)	BNP Paribas S.A.
USD	47,418	ZAR	(880,222)	19/10/2023	1,331	BNP Paribas S.A.

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2023 roku

USD	53,391	PLN	(223,000)	21/07/2023	(1,444)	Toronto Dominion Bank
USD	129,653	CLP	(104,947,872)	03/07/2023	(1,180)	Bank of America
USD	112,676	ZAR	(2,068,330)	14/08/2023	3,665	BNP Paribas S.A.
USD	72,336	PLN	(302,000)	21/07/2023	(1,925)	BNP Paribas S.A.
USD	419,870	ZAR	(7,760,625)	15/08/2023	10,886	Barclays London
USD	1,105,305	GBP	(874,465)	16/08/2023	(6,715)	UBS AG
USD	50,039	CAD	(66,899)	16/08/2023	(552)	JP Morgan Securities Plc
USD	344,651	ZAR	(6,413,893)	15/08/2023	6,640	BNP Paribas S.A.
USD	1,264,442	GBP	(998,332)	16/08/2023	(5,095)	JP Morgan Securities Plc
USD	16,680,845	EUR	(15,144,000)	16/08/2023	121,639	JP Morgan Securities Plc
USD	487,919	ZAR	(9,252,066)	17/08/2023	432	UBS AG
USD	10,069	NZD	(15,878)	16/08/2023	343	Bank of America
USD	30,455	CAD	(40,734)	16/08/2023	(350)	Bank of America
USD	243,805	GBP	(192,960)	16/08/2023	(1,574)	Royal Bank Of Canada, Toronto
USD	113,549	GBP	(90,468)	16/08/2023	(1,496)	Barclays London
USD	371,369	ZAR	(7,249,312)	17/08/2023	(10,594)	UBS AG
USD	654,986	ZAR	(12,708,172)	18/08/2023	(14,536)	MS (FX OPS) London
USD	3,095,994	JPY	(427,046,000)	28/08/2023	115,362	JP Morgan Securities Plc
USD	3,480,866	JPY	(479,954,000)	28/08/2023	130,956	Bank of America
USD	52,197	CAD	(71,000)	16/08/2023	(1,496)	Standard Chartered Bank London
USD	87,135	EUR	(81,000)	16/08/2023	(1,435)	JP Morgan Securities Plc
USD	56,134	PLN	(239,000)	21/07/2023	(2,635)	BNP Paribas S.A.
USD	87,014	CAD	(116,000)	16/08/2023	(710)	Goldman Sachs Bank USA
USD	58,457	PLN	(241,000)	21/07/2023	(803)	Barclays London
USD	659,981	PEN	(2,430,049)	20/09/2023	(6,265)	JPMorgan Chase & Co.
USD	707,041	MXN	(12,253,019)	16/08/2023	(1,178)	Royal Bank Of Canada, Toronto
USD	1,082,411	BRL	(5,226,422)	05/07/2023	(811)	Goldman Sachs Bank USA
USD	645,016	SGD	(862,042)	20/09/2023	6,128	UBS AG
USD	128,981	CLP	(104,947,872)	19/10/2023	(242)	State Street Bank International
USD	56,667	PLN	(231,000)	21/07/2023	(135)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
USD	88,192	PEN	(321,109)	12/07/2023	(321)	Goldman Sachs Bank USA
USD	1,180	HUF	(406,600)	22/08/2023	6	JPMorgan Chase & Co.
USD	66,802	EUR	(60,852)	31/07/2023	316	JPMorgan Chase & Co.
USD	70,605	EUR	(64,620)	31/07/2023	2	JPMorgan Chase & Co.
USD	242,007	EUR	(221,976)	31/07/2023	(520)	JPMorgan Chase & Co.
USD	12,063	EUR	(10,988)	31/07/2023	57	JPMorgan Chase & Co.
USD	57,913	EUR	(53,004)	31/07/2023	2	JPMorgan Chase & Co.
ZAR	401,746	USD	(21,949)	15/08/2023	(777)	MS (FX OPS) London
ZAR	2,084,088	USD	(113,874)	14/08/2023	(4,032)	JP Morgan Securities Plc
					Razem (464,804)	

Na dzień 30 czerwca 2023 roku, Subfundusz SANTANDER FUTURE WEALTH miał zawarte następujące terminowe kontrakty walutowe:

	Kupiona ilość		Sprzedana ilość	Data zapadalności	Niezrealizowane USD	Druga strona kontraktu
BRL	42,064,795	USD	(8,771,722)	31/07/2023	(96,574)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	380,298	USD	(419,193)	31/07/2023	(3,686)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	106,850	USD	(116,746)	31/07/2023	(4)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	40,983	USD	(44,946)	31/07/2023	(169)	JPMorgan Chase & Co.
GBP	30,000	USD	(38,205)	31/07/2023	(57)	JPMorgan Chase & Co.
GBP	63,459	USD	(81,346)	31/07/2023	(651)	JPMorgan Chase & Co.
USD	178,000	BRL	(866,255)	31/07/2023	(650)	JPMorgan Chase & Co.
USD	24,000	BRL	(117,448)	31/07/2023	(222)	JPMorgan Chase & Co.
USD	17,408	GBP	(13,794)	31/07/2023	(132)	JPMorgan Chase & Co.
USD	12,058	EUR	(10,979)	31/07/2023	63	JPMorgan Chase & Co.
					Razem (102,082)	

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2023 roku

Nota 12 - Kontrakty futures

Na dzień 30 czerwca 2023 roku, Subfundusz SANTANDER GO DYNAMIC BOND miał zawarte następujące kontrakty futures:

Opis	Data zapadalności	Waluta	Ilość kontraktów kupiona/ (sprzedana)	Wartość rynkowa	Niezrealizowa USD ne USD	Druga strona kontraktu
EURO-BOBL	07/09/2023	EUR	(56)	(6,479,760)	92,528	UBS Europe SE
EURO-BUND	07/09/2023	EUR	(23)	(3,076,020)	31,737	Barclays Bank London
EURO-SCHATZ	07/09/2023	EUR	(43)	(4,508,550)	41,202	Citigroup Global Markets Europe AG
LONG GILT FUTURE BOND	27/09/2023	GBP	(3)	(285,900)	3,331	Banco Santander S.A.
US 10YR NOTE (CBT) BOND	20/09/2023	USD	(109)	(12,236,953)	158,304	Banco Santander S.A.
US 10YR ULTRA FUTURE	20/09/2023	USD	(159)	(18,831,563)	188,461	Banco Santander S.A.
US 2Y NOTE (CBT) BOND	29/09/2023	USD	69	14,030,719	(204,844)	Barclays Bank London
US 5YR NOTE (CBT) BOND	29/09/2023	USD	(27)	(2,891,531)	57,164	Barclays Bank London
US ULTRA CBT BOND	20/09/2023	USD	(46)	(6,266,063)	(72,594)	Banco Santander S.A.
				Razem	295,289	

Nota 13 - Kontrakty na opcje

Na dzień 30 czerwca 2023 roku, Subfundusz SANTANDER GO NORTH AMERICAN EQUITY miał zawarte kontrakty na opcje:

Opis	Waluta	Kupno/ sprzedaż	Data zapadalności	Cena wykonania	Ilość kupiona	Wartość rynkowa USD	Druga strona kontraktu
FOREIGN EXCHANGE OPTION - FXO	USD	Sprzedaż	21/07/2023	7.53	142,136,491	16,271	JPMorgan Chase Bank
FOREIGN EXCHANGE OPTION - FXO	USD	Sprzedaż	23/08/2023	7.57	164,659,891	109,092	Standard Chartered Bank London
FOREIGN EXCHANGE OPTION - FXO	USD	Sprzedaż	09/10/2023	7.87	1,301,072	398	Goldman Sachs Bank Europe SE
FOREIGN EXCHANGE OPTION - FXO	USD	Sprzedaż	17/01/2023	7.43	127,828,145	855,165	JP Morgan (Germany)
FOREIGN EXCHANGE OPTION - FXO	USD	Sprzedaż	24/05/2024	7.57	165,871,737	1,037,304	JP Morgan (Germany)
					Razem	2,018,230	

Na dzień 30 czerwca 2023 roku, Subfundusz SANTANDER GO DYNAMIC BOND miał zawarte następujące kontrakty na opcje:

Opis	Waluta	Kupno/ sprzedaż	Data zapadalności	Cena wykonania	Ilość kupiona	Wartość rynkowa USD	Druga strona kontraktu
SWAPTION - SOP	USD	Sprzedaż	15/09/2023	2.10	1,000,000	251,303	Morgan Stanley Capital Services
SWAPTION - SOP	USD	Sprzedaż	25/10/2023	2.06	1,600,000	409,327	Bank of America
					Razem	660,630	

Opis	Waluta	Kupno/ sprzedaż	Data zapadalności	Cena wykonania	Ilość sprzedana	Zaangażowanie	Wartość rynkowa USD	Druga strona kontraktu
SWAPTION - SOP	USD	Sprzedaż	20/10/2023	3.02	(300,000)	5,697	(36)	Goldman Sachs Bank USA
SWAPTION - SOP	USD	Sprzedaż	23/10/2023	3.23	(300,000)	7,980	(51)	Goldman Sachs Bank USA

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2023 roku

SWAPTION - SOP	USD	Sprzedaż	23/10/2023	3.19	(300,000)	7,575	(48)	Goldman Sachs Bank USA
SWAPTION - SOP	USD	Sprzedaż	23/10/2023	3.14	(300,000)	7,035	(45)	Goldman Sachs Bank USA
SWAPTION - SOP	USD	Sprzedaż	25/10/2023	2.97	(300,000)	5,838	(38)	Goldman Sachs Bank USA
SWAPTION - SOP	USD	Sprzedaż	27/10/2023	2.84	(300,000)	5,148	(34)	Goldman Sachs Bank USA
SWAPTION - SOP	USD	Sprzedaż	20/07/2023	3.25	(200,000)	20,488	(246)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	USD	Kupno	20/10/2023	3.02	(300,000)	294,519	(6,152)	Goldman Sachs Bank USA
SWAPTION - SOP	USD	Kupno	20/10/2023	3.23	(300,000)	292,230	(5,566)	Goldman Sachs Bank USA
SWAPTION - SOP	USD	Kupno	20/10/2023	3.19	(300,000)	292,635	(5,663)	Goldman Sachs Bank USA
SWAPTION - SOP	USD	Kupno	20/10/2023	3.14	(300,000)	293,178	(5,802)	Goldman Sachs Bank USA
SWAPTION - SOP	USD	Kupno	15/09/2023	1.96	(5,000,000)	4,987,600	(473,422)	Morgan Stanley Capital Services
SWAPTION - SOP	USD	Kupno	25/10/2023	2.00	(8,000,000)	7,925,280	(723,453)	Bank of America
SWAPTION - SOP	USD	Kupno	25/10/2023	2.97	(300,000)	294,273	(6,265)	Goldman Sachs Bank USA
SWAPTION - SOP	USD	Kupno	27/10/2023	2.84	(300,000)	295,074	(6,588)	Goldman Sachs Bank USA
SWAPTION - SOP	USD	Kupno	20/07/2023	3.65	(200,000)	65,886	(893)	JP Morgan (Germany)
						Razem	(1,234,302)	

Na dzień 30 czerwca 2023 roku, Subfundusz SANTANDER FUTURE WEALTH miał zawarte następujące kontrakty na opcje:

Opis	Waluta	Kupno/ sprzedaż	Data zapadalności	Cena wykonania	Ilość kupiona	Wartość rynkowa USD	Druga strona kontraktu
E-MINI NASDAQ 100	USD	Sprzedaż	15/09/2023	11,400.00	17	25,245	Banco Santander S.A.
					Razem	25,245	

Opis	Waluta	Kupno/ sprzedaż	Data zapadalności	Cena wykonania	Ilość sprzedana	Zaangażowanie	Wartość rynkowa USD	Druga strona kontraktu
E-MINI NASDAQ 100	USD	Sprzedaż	15/09/2023	13,000.00	(17)	3,734,900	25,245	Banco Santander S.A.
					Razem		25,245	

Nota 14 – Kontrakty swap ryzyka kredytowego

Na dzień 30 czerwca 2023 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
100,000	USD	CDS	SELL	1.000%	12/24	954	954	BNP Paribas S.A.
300,000	USD	CDS	SELL	1.000%	12/25	2,140	2,140	BNP Paribas S.A.
100,000	USVS	CDS	SELL	1.000%	06/26	713	713	Morgan Stanley & Co. Incorporated
300,000	USVS	CDS	SELL	1.000%	06/26	2,139	2,139	Morgan Stanley & Co. Incorporated
200,000	USVS	CDS	SELL	5.000%	12/25	19,973	19,973	Morgan Stanley & Co. Incorporated
300,000	USVS	CDS	SELL	5.000%	12/25	29,959	29,959	Morgan Stanley & Co. Incorporated
600,000	USVS	CDS	SELL	5.000%	12/25	62,947	62,948	Morgan Stanley & Co. Incorporated
100,000	USVS	CDS	SELL	5.000%	12/25	9,986	9,986	Morgan Stanley & Co. Incorporated

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2023 roku

200,000	EUVS	CDS	SELL	1.000%	06/28	1,449	1,449	Morgan Stanley & Co. Incorporated
100,000	EUVS	CDS	SELL	1.000%	06/28	725	725	Morgan Stanley & Co. Incorporated
300,000	EUVS	CDS	SELL	1.000%	06/28	2,174	2,174	Morgan Stanley & Co. Incorporated
200,000	EUR	CDS	SELL	5.000%	12/26	28,509	28,509	JP Morgan Chase Bank
100,000	EUR	CDS	SELL	5.000%	12/26	14,254	14,254	JP Morgan Chase Bank
100,000	USVS	CDS	SELL	1.000%	06/28	141	141	Morgan Stanley & Co. Incorporated
					Razem	176,063	176,063	

Ilość	Waluta	Jednostka ref.	Kupno/Sprzedaż	Odsetki (Zapłacone) Otrzymane	Data zapadalności	Wartość rynkowa USD	Niezrealizowany zysk/(strata) USD	Druga strona kontraktu
1,700,000	USVS	CDI	BUY	5.000%	06/28	(50,012)	(50,012)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
200,000	USD	CDS	SELL	1.000%	12/24	(430)	(430)	Barclays Bank
200,000	USD	CDS	SELL	1.000%	12/25	(3,180)	(3,180)	Goldman Sachs Bank USA
					Razem	(53,622)	(53,622)	

Nota 15 – Kontrakty swap stóp procentowych

Na dzień 31 czerwca 2023 roku, Subfundusz SANTANDER GO DYNAMIC BOND miał zawarte następujące kontrakty swap stóp procentowych:

Ilość	Waluta	Data zapadalności	Opis	Stopa procentowa otrzymana	Stopa procentowa zapłacona	Niezrealizowany zysk/(strata) EUR	Druga strona kontraktu
150,000	EUVS	09/33	IRS	3.000%	EURIBOR 6M	245	Morgan Stanley & Co. Incorporated
150,000	EUVS	09/33	IRS	3.000%	EURIBOR 6M	245	Morgan Stanley & Co. Incorporated
300,000	EUVS	09/33	IRS	3.000%	EURIBOR 6M	489	Morgan Stanley & Co. Incorporated
200,000	EUVS	09/33	IRS	3.000%	EURIBOR 6M	326	Morgan Stanley & Co. Incorporated
600,000	EUVS	09/33	IRS	3.000%	EURIBOR 6M	978	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,280,000	USVS	09/23	IRS	LIBOR 3M	0.000%	17,295	Morgan Stanley & Co. Incorporated
100,000	USVS	09/23	IRS	LIBOR 3M	0.000%	1,351	Morgan Stanley & Co. Incorporated
11,175,800,000	KRVS	12/26	NDIRS	KSDA 3M	1.750%	517,413	Morgan Stanley & Co. Incorporated
13,411,195	BRVS	01/27	OIS	11.048%	CDI 1D	27,043	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,079,736	BRVS	01/27	OIS	11.086%	CDI 1D	2,187	Morgan Stanley & Co. Incorporated
5,098,315	BRVS	01/27	OIS	11.098%	CDI 1D	10,951	Morgan Stanley & Co. Incorporated
3,892,730	BRVS	01/27	OIS	11.814%	CDI 1D	38,095	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,050,000	USVS	12/52	OIS	SOFR 1D	1.750%	301,710	Morgan Stanley & Co. Incorporated
450,000	USVS	12/52	OIS	SOFR 1D	1.750%	129,304	Morgan Stanley & Co. Incorporated
3,854,850	BRVS	01/25	OIS	11.835%	CDI 1D	1,418	Morgan Stanley & Co. Incorporated
3,857,657	BRVS	01/25	OIS	11.800%	CDI 1D	763	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,400,000	GBVS	09/28	OIS	SONIA 1D	3.750%	95,765	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,400,000	GBVS	09/28	OIS	SONIA 1D	3.750%	95,765	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,280,000	USVS	03/31	OIS	SOFR 1D	0.750%	283,948	Morgan Stanley & Co. Incorporated
100,000	USVS	03/31	OIS	SOFR 1D	0.750%	22,183	Morgan Stanley & Co. Incorporated
800,000	USVS	09/23	OIS	SOFR 1D	0.000%	10,823	Morgan Stanley & Co. Incorporated
2,200,000	USVS	09/23	OIS	SOFR 1D	0.000%	30,430	Morgan Stanley & Co. Incorporated
27,300,000	USVS	08/23	OIS	SOFR 1D	0.000%	372,438	Morgan Stanley & Co. Incorporated
500,000	USVS	06/33	OIS	SOFR 1D	3.000%	23,699	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,000,000	USVS	06/33	OIS	SOFR 1D	3.000%	47,399	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,300,000	USVS	07/53	OIS	SOFR 1D	1.999%	292,839	Morgan Stanley & Co. Incorporated
					Razem	2,325,102	

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2023 roku

Ilość	Waluta	Data zapadalności	Opis	Stopa procentowa otrzymana	Stopa procentowa zapłacona	Niezrealizowany zysk/(strata) EUR	Druga strona kontraktu
1,000,000	CADS	11/23	IRS	2.000%	BA 3M	(12,200)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
3,100,000	CADS	11/23	IRS	2.000%	BA 3M	(37,819)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
3,500,000	CADS	10/23	IRS	2.060%	BA 3M	(42,458)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,500,000	CADS	10/23	IRS	2.060%	BA 3M	(18,196)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,500,000	CADS	10/23	IRS	2.060%	BA 3M	(18,196)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
700,000	CADS	10/23	IRS	2.060%	BA 3M	(8,492)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,000,000	CADS	10/23	IRS	2.060%	BA 3M	(12,131)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
2,100,000	CADS	10/23	IRS	2.060%	BA 3M	(25,475)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
400,000	NZVS	11/23	IRS	3.000%	BBR 3M	(3,277)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,100,000	NZVS	11/23	IRS	3.000%	BBR 3M	(9,011)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
800,000	NZVS	11/23	IRS	3.000%	BBR 3M	(6,553)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,100,000	NZVS	11/23	IRS	3.000%	BBR 3M	(9,011)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,100,000	NZVS	11/23	IRS	3.000%	BBR 3M	(9,011)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,300,000	NZVS	12/23	IRS	3.000%	BBR 3M	(10,843)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,300,000	NZVS	12/23	IRS	3.000%	BBR 3M	(10,843)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,100,000	NZVS	12/23	IRS	3.000%	BBR 3M	(9,174)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,100,000	NZVS	12/23	IRS	3.000%	BBR 3M	(9,174)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,100,000	NZVS	12/23	IRS	3.000%	BBR 3M	(9,174)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,100,000	NZVS	12/23	IRS	3.000%	BBR 3M	(9,174)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,100,000	NZVS	12/23	IRS	3.000%	BBR 3M	(9,174)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,100,000	NZVS	12/23	IRS	3.000%	BBR 3M	(9,174)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,100,000	NZVS	12/23	IRS	3.000%	BBR 3M	(9,174)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,100,000	NZVS	12/23	IRS	3.000%	BBR 3M	(9,174)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,800,000	NZVS	12/23	IRS	3.000%	BBR 3M	(15,013)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
2,700,000	NZVS	12/23	IRS	3.000%	BBR 3M	(22,519)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
300,000	EUVS	04/27	IRS	0.700%	EURIBOR 6M	(32,898)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
600,000	EUVS	04/27	IRS	0.650%	EURIBOR 6M	(66,947)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
500,000	EUVS	05/27	IRS	0.650%	EURIBOR 6M	(55,793)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
700,000	EUVS	05/27	IRS	1.000%	EURIBOR 6M	(68,161)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
3,300,000	PLVS	09/27	IRS	WIBOR 6M	6.310%	(61,168)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
3,200,000	PLVS	09/27	IRS	WIBOR 6M	6.270%	(57,773)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
2,800,000	PLVS	09/27	IRS	WIBOR 6M	6.240%	(49,837)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
3,400,000	PLVS	09/27	IRS	WIBOR 6M	6.250%	(60,890)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
4,900,000	PLVS	09/27	IRS	WIBOR 6M	6.280%	(89,889)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
4,700,000	PLVS	10/27	IRS	WIBOR 6M	6.985%	(123,490)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
2,400,000	PLVS	10/27	IRS	WIBOR 6M	7.156%	(67,622)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
3,300,000	PLVS	09/27	IRS	WIBOR 6M	6.160%	(55,348)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
700,000	USVS	09/23	IRS	0.500%	LIBOR 3M	(7,992)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
800,000	USVS	09/23	IRS	0.000%	LIBOR 3M	(10,651)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
2,200,000	USVS	09/23	IRS	0.000%	LIBOR 3M	(29,948)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
27,300,000	USVS	08/23	IRS	0.000%	LIBOR 3M	(362,399)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
2,261,900,000	KRVS	12/26	NDIRS	1.750%	KSDA 3M	(104,721)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
3,324,000,000	KRVS	12/26	NDIRS	1.750%	KSDA 3M	(153,894)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
2,238,300,000	KRVS	12/26	NDIRS	1.750%	KSDA 3M	(103,628)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
3,351,600,000	KRVS	12/26	NDIRS	1.750%	KSDA 3M	(155,171)	Morgan Stanley & Co. Incorporated

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2023 roku

1,163,396	BRVS	01/27	OIS	10.206%	CDI 1D	(8,620)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
2,770,000	USVS	05/32	OIS	1.853%	SOFR 1D	(373,815)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
3,862,958	BRVS	01/25	OIS	11.734%	CDI 1D	(474)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
300,000	USVS	02/30	OIS	3.470%	SOFR 1D	(6,191)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
100,000	USVS	02/53	OIS	3.080%	SOFR 1D	(3,022)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
200,000	USVS	02/33	OIS	3.400%	SOFR 1D	(3,932)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
200,000	USVS	02/33	OIS	3.430%	SOFR 1D	(3,399)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
100,000	USVS	03/33	OIS	3.405%	SOFR 1D	(1,902)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
100,000	USVS	03/33	OIS	3.425%	SOFR 1D	(1,734)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
100,000	USVS	03/30	OIS	3.525%	SOFR 1D	(1,692)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
300,000	USVS	03/33	OIS	3.300%	SOFR 1D	(8,287)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
300,000	USVS	03/33	OIS	3.450%	SOFR 1D	(4,504)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
300,000	USVS	03/28	OIS	3.800%	SOFR 1D	(3,198)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,300,000	GBVS	09/33	OIS	3.500%	SONIA 1D	(105,134)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,200,000	GBVS	09/33	OIS	3.500%	SONIA 1D	(97,047)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
870,000	GBVS	09/33	OIS	3.500%	SONIA 1D	(70,359)	Morgan Stanley & Co. Incorporated

Nota 17 – umowy z przyrzeczeniem odkupu

430,000	GBVS	09/33	OIS	3.500%	SONIA 1D	(34,775)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
700,000	USVS	06/26	OIS	0.500%	SOFR 1D	(72,395)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,280,000	USVS	09/23	OIS	0.000%	SOFR 1D	(34,275)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
100,000	USVS	09/23	OIS	0.000%	SOFR 1D	(2,678)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
27,300,000	USVS	11/23	OIS	1.270%	SOFR 1D	(580,324)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
800,000	USVS	03/25	OIS	0.613%	SOFR 1D	(59,020)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
2,200,000	USVS	03/25	OIS	0.622%	SOFR 1D	(162,590)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
8,500,000	CADS	06/25	OIS	4.000%	REPO CORRA 1D	(89,893)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
5,300,000	CADS	06/25	OIS	4.000%	REPO CORRA 1D	(56,051)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
6,400,000	USVS	07/28	OIS	1.827%	SOFR 1D	(596,934)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
600,000	EUVS	04/24	IRSZC	2.250%	EURIBOR 3M	(10,002)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
600,000	EUVS	05/24	IRSZC	2.250%	EURIBOR 3M	(10,037)	Morgan Stanley & Co. Incorporated

Na dzień 30 czerwca 2023 roku subfundusz SANTANDER GO DYNAMIC BOND zawarł kontrakty z przyrzeczeniem odkupu, których kwota została ujawniona poniżej w walucie Subfunduszu, na mocy których pożyczka określonej kwoty instytucjom finansowym, zabezpieczoną zabezpieczeniem. Na dzień 30 czerwca 2023 roku pożyczki udzielone na podstawie tych umów były zabezpieczone następującymi aktywami bazowymi:

Waluta	Wartość nominalna	Opis	Druga strona	Kwota w USD (koszt)	Kwota w USD (wartość rynkowa zabezpieczenia)
USD	13,201,892	RRGOVBOND 5.16 122076 03	BNP PARIBAS S.A.	13,200,000	13,483,824

Nota 18 – Globalny przegląd zabezpieczeń

Na dzień 30 czerwca 2023 roku, Spółka spółka ustanowiła następujące zabezpieczenia na rzecz kontrahentów instrumentów finansowych:

Subfundusz	Waluta	Zabezpieczenie pozarynkowym regulowanym	Typ zabezpieczenia	Druga strona)
SANTANDER GO DYNAMIC BOND	USD	133,790	gotówka	Bank of America NA
SANTANDER GO DYNAMIC BOND	USD	60,195	gotówka	Morgan Stanley & Co. International PLC
SANTANDER GO DYNAMIC BOND	USD	221,691	gotówka	Morgan Stanley Capital Services LCC
SANTANDER GO DYNAMIC BOND	USD	90,101	gotówka	The Toronto-Dominion Bank

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2023 roku

Na dzień 30 czerwca 2023 roku kontrahenci umów swap ustanowili na rzecz Spółki następujące zabezpieczenia:

Subfundusz	Waluta	Zabezpieczenie pozarynkowym regulowanym	Typ zabezpieczenia	Druga strona)
SANTANDER GO DYNAMIC BOND	USD	13,483,824	amerykańskie obligacje skarbowe	BNP Paribas S.A.
SANTANDER GO DYNAMIC BOND	USD	351,236	gotówka	JP Morgan Chase Bank, N.A
SANTANDER GO NORTH AMERICA	USD	414,879	gotówka	JP Morgan Chase Bank, N.A
SANTANDER GO NORTH AMERICA	USD	4,607	gotówka	JP Morgan Chase Bank, N.A
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG	USD	13,250	gotówka	JP Morgan Chase Bank, N.A
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG	EUR	2,364,195	gotówka	JP Morgan Chase Bank, N.A
SANTANDER FUTURE WEALTH	USD	350,640	gotówka	JP Morgan Chase Bank, N.A

Nota 19 – wartość inwestycji pomiędzy Subfunduszami

Na dzień 30 czerwca 2023 roku ogólna wartość inwestycji pomiędzy Subfunduszami wyniosła 2,041,696 EUR w związku z tym ogólne skonsolidowane aktywa netto na koniec bez ww. pozycji wyniosły 4,472,487,053 EUR.

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Inne informacje

Załącznik 1: Rozporządzenie w sprawie przejrzystości transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i ponownego wykorzystania ("Rozporządzenie SFTR")

Na dzień 30 czerwca 2023 roku, fundusz SICAV spełnia wymagania Rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) w sprawie przejrzystości transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i ponownego wykorzystania („SFTR”). Na dzień 30 czerwca 2023 r. przepisom niniejszego Rozporządzenia podlegały transakcje swapów total return.

SANTANDER GO DYNAMIC BOND

	USD
Kwota umów z udzielonym przyrzeczeniem odkupu wyrażona w wartościach bezwzględnych	13,200,000
Udział w wartości zarządzanych aktywów	10.51%
Termin zapadalności umów z przyrzeczeniem odkupu w rozbiciu na następujące przedziały czasowe (wartości bezwzględne)	
Poniżej jednego dnia	-
Jeden dzień do jednego tygodnia	13,200,000
Jeden tydzień do jednego miesiąca	-
Jeden do trzech miesięcy	-
Trzy miesiące do roku	-
Powyżej jednego roku	-
Termin otwarty	-
Razem	13,200,000
Druga strona umowy	
Nazwa drugiej strony kontraktu	Patrz nota 17
Kraj domicylu drugiej strony umowy	Patrz nota 17
Wolumen nierozliczonych transakcji brutto	13,200,000
Informacje o zabezpieczeniu	
Rodzaj zabezpieczenia:	
Srodki pieniężne	-
Papiery wartościowe	13,483,824
Jakość zabezpieczenia:	
Rating	AA
Data zapadalności zabezpieczenia w rozbiciu na następujące przedziały czasowe	
Poniżej jednego dnia	-
Jeden dzień do jednego tygodnia	-
Jeden tydzień do jednego miesiąca	-
Jeden do trzech miesięcy	-
Trzy miesiące do roku	-
Powyżej jednego roku	13,483,824
Termin otwarty	-
Razem	13,483,824
Przechowywanie zabezpieczeń otrzymanego przez fundusz w ramach umów z przyrzeczeniem odkupu	
Nazwa depozytariusza	BNP PARIBAS S.A..
Srodki pieniężne	-
Papiery wartościowe	13,483,824

Wszystkie transakcje są transakcjami dwustronnymi.

Zabezpieczenia wynikające z umów przyrzeczeniem odkupu nie są ponownie wykorzystywane. Wszystkie zyski z transakcji na instrumentach pochodnych finansowanych z użyciem papierów wartościowych będą napływać do funduszu i nie będą podlegać żadnym umowom o podziale zysków z menadżerem spółki ani żadnymi innymi stronami trzecimi. W przypadku umów z przyrzeczeniem odkupu fundusz nie ponosi kosztów transakcyjnych. Koszty pośrednie dotyczą opłat rozliczeniowych, depozytowych i administracyjnych pobieranych przez naszego depozytariusza. Zyski są identyfikowane jako „inne dochody” w okresie sprawozdawczym w zestawieniu operacji.