

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

(Société d'Investissement à Capital Variable)

Nierewidowany raport półroczny za okres od 1 stycznia 2024 do 30 czerwca 2024 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 2024 roku

Zestawienie aktywów netto na dzień 30 czerwca 2024 roku

Skonsolidowane zestawienie operacji i zmian w aktywach netto funduszu za okres kończący się 30 czerwca 2024 roku

Zestawienie operacji i zmian w aktywach netto funduszu za okres kończący się 30 czerwca 2024 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 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 GO GLOBAL ENVIRONMENTAL SOLUTIONS

SANTANDER GO DYNAMIC BOND

SANTANDER LATIN AMERICAN INVESTMENT GRADE ESG BOND

SANTANDER FUTURE WEALTH

SANTANDER GO GLOBALHIGH YIELD BOND

SANTANDER PROSPERITY

SANTANDER TARGET MATURITY 2026 EURO

SANTANDER TARGET MATURITY 2026 DOLLAR

SANTANDER GO ASIAN EQUITY

SANTANDER US EQUITY ESG

SANTANDER TARGET MATURITY 2025 EURO

SANTANDER TARGET MATURITY EURO II

SANTANDER US EQUITY HEDGED

Informacje dodatkowe do sprawozdań finansowych na dzień 30 czerwca 2024 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
43, Avenue John F. Kennedy
L-1855 Luksemburg

Dyrektorzy

Pan Carlos DIAZ NÚÑEZ Global Head
Globalny Dyrektor Produktów Detalicznych i Rozwiązań dla
Klientów Santander Asset Management
Ciudad Grupo Santander 28660 Boadilla del Monte, Madryt
Hiszpania

Mr Stefan JOCHUM CEO
Santander Asset Management S.A., S.G.I.I.C., (German Branch)
Thurn-und-Taxis-Platz 6 60313 Frankfurt and Menem
Niemcy

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

J.P. MORGAN SE,
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 FUTURE WEALTH
 - SANTANDER SELECT INCOME
 - SANTANDER SELECT DEFENSIVE
 - SANTANDER SELECT MODERATE
 - SANTANDER SELECT DYNAMIC
-

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Dyrektorzy i administracja (c.d.)

- SANTANDER PROSPERITY
- SANTANDER TARGET MATURITY EURO II
- SANTANDER TARGET MATURITY 2025 EURO
- SANTANDER TARGET MATURITY 2026 EURO
- SANTANDER TARGET MATURITY 2026 DOLLAR
- SANTANDER US EQUITY ESG
- SANTANDER AM LATIN AMERICAN EQUITY OPPORTUNITIES
- SANTANDER US EQUITY HEDGED
- SANTANDER COVERED BOND (do 21 maja 2024 roku)

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 MULTI INDEX INCOME
- SANTANER LATIN AMERICAN INVESTMENT GRADE ESG BOND

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

Dla subfunduszu:

- SANTANDER GO ABSOLUTE RETURN

RBC GLOBAL ASSET MANAGEMENT (UK) LIMITED
4th Floor, 100 Bishopsgate London, EC2N 4AA
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

BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT UK LIMITED
5 Aldermanbury square, London, EC2V 7BP,
Wielka Brytania

Dla subfunduszu:

- SANTANDER GO GLOBAL ENVIRONMENTAL SOLUTIONS
(od 21 maja 2024 roku)

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 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: 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 (z wyjątkiem Posiadaczy Tytułów Uczestnictwa z domicyłem podatkowym, rezydentów lub posiadaczy prawa stałego pobytu w Luksemburgu).

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



Skonsolidowane zestawienie aktywów netto na dzień 30 czerwca 2024 roku

	Noty	EUR
AKTYWA		
Inwestycje w papiery wartościowe po cenie rynkowej	3.1	4,653,334,238
Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 14	132,425
Opcje kupione po cenie rynkowej	3.6, 13	5,615,881
Środki pieniężne w banku	3.1	117,834,374
Środki pieniężne u brokera	3.1	40,509,124
Należności z tytułu sprzedaży papierów wartościowych		31,619,016
Należności z subskrypcji		4,323,429
Należności z tytułu odsetek i dywidend	3.12	22,326,124
Rozliczenia międzyokresowe kosztów	3.13	836,234
Należność z tytułu umów z otrzymanym przyrzeczeniem odkupu	3.10, 17	15,208,771
Niezrealizowany zysk na kontraktach walutowych forward	3.4, 11	2,328,371
Niezrealizowany zysk na kontraktach futures	3.5, 12	2,133,693
Niezrealizowany zysk na kontraktach swap na stopy procentowe	3.7, 15	2,346,571
Inne należności		3,612,841
Aktywa ogółem		4,902,161,092
PASYWA		
Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 14	105,806
Wartość rynkowa opcji	3.6, 13	3,765,247
Kredyt w rachunku bankowym	3.1	700,125
Kredyt w rachunku brokera	3.1	574,019
Zobowiązania z tytułu odsetek i dywidend netto	3.12	34,741
Kwoty płatne z tytułu nabytych papierów wartościowych		64,273,591
Zobowiązania z tytułu umorzeń		6,631,566
Zobowiązania z tytułu podatków i inne koszty	6	7,280,118
Niezrealizowana strata z kontraktów walutowych	3.4, 11	2,516,385
Niezrealizowana strata z kontraktów futures	3.5, 12	1,858,594
Niezrealizowana strata z kontraktów swap stóp proc.	3.7, 15	1,819,394
Inne wymagane płatności		409,319
Pasywa ogółem		89,968,906
Aktywa netto razem		4,812,192,186

Zestawienie aktywów netto na dzień 30 czerwca 2024 roku

		SANTANDER AM EURO EQUITY
	Noty	EUR
AKTYWA		
Inwestycje w papiery wartościowe po cenie rynkowej	3.1	410,644,202
Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 14	-
Opcje kupione po cenie rynkowej	3.6, 13	-
Środki pieniężne w banku	3.1	11,027,890
Środki pieniężne u brokera	3.1	7,175,337
Należności z tytułu sprzedaży papierów wartościowych		1,587,665
Należności z subskrypcji		3,000
Należności z tytułu odsetek i dywidend netto	3.12	99,794
Rozliczenia międzyokresowe kosztów	3.13	24,754
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		1,904,320
Aktywa ogółem		432,466,962
PASYWA		
Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 14	-
Wartość rynkowa opcji	3.6, 13	-
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		1,485,238
Zobowiązania z tytułu umorzeń		43,095
Zobowiązania z tytułu podatków i inne koszty	6	507,170
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		2,035,503
Aktywa netto razem		430,431,459

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie aktywów netto na dzień 30 czerwca 2024 roku

SANTANDER GO
GLOBAL EQUITY
ESG
USD

	Noty	
AKTYWA		
Inwestycje w papiery wartościowe po cenie rynkowej	3.1	677,456,026
Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 14	-
Opcje kupione po cenie rynkowej	3.6, 13	-
Środki pieniężne w banku	3.1	11,540,607
Środki pieniężne u brokera	3.1	5,114,000
Należności z tytułu sprzedaży papierów wartościowych		-
Należności z subskrypcji		1,502,769
Należności z tytułu odsetek i dywidend	3.12	148,537
Rozliczenia międzyokresowe kosztów	3.13	23,195
Należność z tytułu umów z otrzymanym przyrzeczeniem odkupu	3.10, 17	-
Niezrealizowany zysk na kontraktach walutowych forward	3.11	159,388
Niezrealizowany zysk na kontraktach futures	3.5, 12	-
Niezrealizowany zysk z kontraktów swap stóp procentowych	3.7, 15	-
Inne należności		390,454
Aktywa ogółem		696,334,976
PASYWA		
Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 14	-
Wartość rynkowa opcji	3.6, 13	-
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		4,793,843
Zobowiązania z tytułu umorzeń		1,148,226
Zobowiązania z tytułu podatków i inne koszty	6	784,745
Niezrealizowana strata z kontraktów walutowych	3.4, 11	1,653,025
Niezrealizowana strata z kontraktów futures	3.5, 12	-
Niezrealizowana strata z kontraktów swap stóp procentowych	3.7, 15	-
Inne wymagane płatności		2,496
Pasywa ogółem		8,382,335
Aktywa netto razem		687,952,641

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie aktywów netto na dzień 30 czerwca 2024 roku

		SANTANDER GO DYNAMIC BOND
	Noty	USD
AKTYWA		
Inwestycje w papiery wartościowe po cenie rynkowej	3.1	129,571,463
Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 14	139,726
Opcje kupione po cenie rynkowej	3.6, 13	16,188
Środki pieniężne w banku	3.1	320,796
Środki pieniężne u brokera	3.1	3,220,116
Należności z tytułu sprzedaży papierów wartościowych		25,024,184
Należności z subskrypcji		448,964
Należności z tytułu odsetek i dywidend netto	3.12	646,899
Wydatki opłacone z góry	3.13	16,560
Należność z tytułu umów z otrzymanym przyrzeczeniem odkupu	3.10, 17	16,300,000
Niezrealizowany zysk netto z kontraktów term. forward	3.4, 11	832,467
Niezrealizowany zysk z kontraktów futures	3.7, 12	58,978
Niezrealizowany zysk z kontraktów swap stóp procentowych	3.7, 15	2,514,937
Inne należności		3,629
Aktywa ogółem		179,114,907
PASYWA		
Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 14	108,259
Wartość rynkowa opcji	3.6, 13	34,100
Kredyt w rachunku bankowym	3.1	578,405
Kredyt w rachunku brokera	3.1	615,204
Zobowiązania z tytułu odsetek i dywidend	3.12	25,655
Zobowiązania z tytułu nabycia papierów wartościowych		54,036,170
Zobowiązania z tytułu umorzeń		88,849
Zobowiązania z tytułu podatków i inne koszty	6	286,210
Niezrealizowana strata z kontraktów walutowych	3.4, 11	247,322
Niezrealizowana strata z kontraktów futures	3.5, 12	394,307
Niezrealizowana strata z kontraktów swap stóp proc.	3.7, 15	1,949,936
Inne wymagane płatności		1,489
Pasywa ogółem		58,365,906
Aktywa netto razem		120,749,001

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie aktywów netto na dzień 30 czerwca 2024 roku

SANTANDER
FUTURE WEALTH

USD

Noty

AKTYWA

Inwestycje w papiery wartościowe po cenie rynkowej	3.1	76,242,942
Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 14	-
Opcje kupione po cenie rynkowej	3.6, 13	117,600
Środki pieniężne w banku	3.1	498,799
Środki pieniężne u brokera	3.1	853,792
Należności z tytułu sprzedaży papierów wartościowych		330,922
Należności z subskrypcji		32,108
Należności z tytułu odsetek i dywidend	3.12	-
Rozliczenia międzyokresowe kosztów	3.13	26,241
Należność z tytułu umów z otrzymanym przyrzeczeniem odkupu	3.10, 17	-
Niezrealizowany zysk netto z kontraktów term. forward	3.4, 11	1,118
Niezrealizowany zysk z kontraktów futures	3.5, 12	7,540
Niezrealizowany zysk z kontraktów swap stóp procentowych	3.7, 15	-
Inne należności		41,034

Aktywa ogółem

78,152,096

PASYWA

Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 14	-
Wartość rynkowa opcji	3.6, 13	38,320
Kredyt w rachunku bankowym	3.1	121,952
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		356,180
Zobowiązania z tytułu podatków i inne koszty	6	138,988
Niezrealizowana strata z kontraktów walutowych	3.4, 11	109,575
Niezrealizowana strata z kontraktów futures	3.5, 12	-
Niezrealizowana strata z kontraktów swap stóp procentowych	3.7, 15	-
Inne wymagane płatności		635

Pasywa ogółem

765,650

Aktywa netto razem

77,386,446

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie aktywów netto na dzień 30 czerwca 2024 roku

SANTANDER
PROSPERITY

USD

Noty

AKTYWA

Inwestycje w papiery wartościowe po cenie rynkowej	3.1	50,585,582
Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 14	-
Opcje kupione po cenie rynkowej	3.6, 13	-
Środki pieniężne w banku	3.1	1,363,510
Środki pieniężne u brokera	3.1	167,450
Należności z tytułu sprzedaży papierów wartościowych		-
Należności z subskrypcji		12,563
Należności z tytułu odsetek i dywidend	3.12	48,040
Rozliczenia międzyokresowe kosztów	3.13	17,136
Należność z tytułu umów z otrzymanym przyrzeczeniem odkupu	3.10, 17	-
Niezrealizowany zysk netto z kontraktów term. forward	3.4, 11	4,091
Niezrealizowany zysk z kontraktów futures	3.5, 12	-
Niezrealizowany zysk z kontraktów swap stóp procentowych	3.7, 15	-
Inne należności		19,454

Aktywa ogółem

52,217,826

PASYWA

Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 14	-
Wartość rynkowa opcji	3.6, 13	-
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		-
Zobowiązania z tytułu podatków i inne koszty	6	47,030
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

47,030

Aktywa netto razem

52,170,796

Zestawienie aktywów netto na dzień 30 czerwca 2024 roku

**SANTANDER US
EQUITY ESG
USD**

	Noty		
AKTYWA			
Inwestycje w papiery wartościowe po cenie rynkowej	3.1	17,391,746	
Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 14	-	
Opcje kupione po cenie rynkowej	3.6, 13	-	
Środki pieniężne w banku	3.1	1,226,940	
Środki pieniężne u brokera	3.1	112,919	
Należności z tytułu sprzedaży papierów wartościowych		-	
Należności z subskrypcji		10,682	
Należności z tytułu odsetek i dywidend netto	3.12	8,150	
Rozliczenia międzyokresowe kosztów	3.13	30,970	
Należność z tytułu umów z otrzymanym przyrzeczeniem odkupu	3.10, 17	-	
Niezrealizowany zysk na kontraktach walutowych forward	3.4, 11	799	
Niezrealizowany zysk na kontraktach futures	3.5, 12	-	
Niezrealizowany zysk na kontraktach swapów procentowych	3.7, 15	-	
Inne należności		1,104	
Aktywa ogółem		18,783,310	
PASYWA			
Kontrakty swap ryzyka kredytowego po cenie rynkowej	3.8, 14	-	-
Wartość rynkowa opcji	3.6, 13	-	
Kredyt w rachunku bankowym	3.1	-	
Kredyt w rachunku brokera	3.1	-	
Należne odsetki i dywidendy	3.12	-	
Zobowiązania z tytułu nabycia pap. wartościowych		-	
Zobowiązania z tytułu umorzeń		-	
Zobowiązania z tytułu podatków i inne koszty	6	18,262	
Niezrealizowana strata z kontraktów walutowych	3.4, 11	4	
Niezrealizowana strata z kontraktów futures	3.5, 12	538	
Niezrealizowana strata z kontraktów swap stóp procentowych	3.7, 15	-	
Inne wymagane płatności		36	
Pasywa ogółem		18,840	
Aktywa netto razem		18,764,470	

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Skonsolidowane zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za kończący się 30 czerwca 2024 roku

	Noty	EUR
Wartość Aktywów Netto na początek okresu		4,487,501,239
DOCHODY		
Dywidendy netto	3.12	26,246,949
Odsetki z tytułu obligacji netto	3.12	43,711,407
Odsetki bankowe netto	3.12	2,755,483
Umowy odkupu	3.10, 17	279,109
Odsetki od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	272,901
Inne dochody		176,044
		73,441,893
KOSZTY		
Opłaty za zarządzanie	5	16,631,862
Opłaty na rzecz depozytariusza	7	270,649
Odsetki bankowe netto	3.12	525,630
Odsetki od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	236,794
Podatek roczny	8	728,206
Amortyzacja wydatków na utworzenie subfunduszy	3.11	2,192
Koszty audytu i prawne		378,615
Koszty administracyjne	7	1,248,328
Inne koszty		1,632,747
		21,655,023

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

	Noty	EUR
Zysk/(strata) netto z inwestycji:		51,786,871
Zrealizowany zysk/(strata) netto z tytułu:		
- inwestycji	3.2	10,166,488
- operacji walutowych	3.3	41,795
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	(16,970,574)
9- kontraktów futures	3.5	14,707,481
- opcji	3.6	(6,561,591)
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	(124,913)
Zrealizowana strata netto za okres		1,258,686
Zmiana niezrealizowanego zysku/(straty) z tytułu:		
- inwestycji	3.2	124,439,930
- operacji walutowych	3.3	(328,652)
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	(2,425,671)
- kontraktów futures	3.5	(4,832,234)
- opcji	3.6	859,640
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	460,840
		118,173,853
Zysk/(strata) netto z operacji		171,219,410
Nabycia	4	610,451,813
Umorzenia	4	(531,725,130)
Wyłączone dywidendy	2	(3,409,827)
Przeszacowanie waluty*	3.3	78,154,681
Wartość Aktywów Netto na koniec okresu		4,812,192,186

* 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 2023 roku oraz kursach obowiązujących na dzień 30 czerwca 2024 roku.

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres kończący się 30 czerwca 2024 roku

	Noty	SANTANDER AM EURO EQUITY EUR
Wartość Aktywów Netto na początek okresu		437,156,070
DOCHODY		
Dywidendy netto	3.12	10,604,189
Odsetki z tytułu obligacji netto	3.12	-
Odsetki bankowe netto	3.12	238,885
Umowa odkupu	3.10, 17	-
Odsetki netto od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
Inne dochody		-
Dochody ogółem		10,843,074
KOSZTY		
Opłaty za zarządzanie	5	535,719
Opłaty na rzecz depozytariusza	7	15,339
Odsetki bankowe netto	3.12	1,192
Odsetki netto od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
Podatek roczny	8	30,253
Amortyzacja wydatków na utworzenie subfunduszy	3.11	-
Koszty audytu i prawne		18,806
Koszty administracyjne	7	106,718
Inne koszty		147,336
Koszty ogółem		855,363

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres kończący się 30 czerwca 2024 roku

		SANTANDER AM EURO EQUITY
	Noty	EUR
Zysk/(strata) netto z inwestycji		9,987,711
Zrealizowany zysk/(strata) netto z tytułu:		
- inwestycji	3.2	900,026
- operacji walutowych	3.3	586
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	-
- kontraktów futures	3.5	478,518
- opcji	3.6	-
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
Zrealizowany zysk/(strata) netto za okres		1,379,130
Zmiana niezrealizowanego zysku/(straty) z tytułu:		
- inwestycji	3.2	19,942,456
- operacji walutowych	3.3	(1,878)
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	-
- kontraktów futures	3.5	-
- opcji	3.6	-
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
Zmiana niezrealizowanego zysku/(straty) w okresie		19,940,578
Zysk/(strata) netto z operacji		31,307,419
Nabycia	4	4,433,654
Umorzenia	4	(42,465,684)
Wyłacone dywidendy	2	-
Wartość Aktywów Netto na koniec okresu		430,431,459

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres kończący się 30 czerwca 2024 roku

	Noty	SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG USD
Wartość Aktywów Netto na początek okresu		560,580,161
DOCHODY		
Dywidendy netto	3.12	3,934,491
Odsetki z tytułu obligacji netto	3.12	-
Odsetki bankowe netto	3.12	195,436
Umowa odkupu	3.10, 17	-
Odsetki netto od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
Inne dochody		-
Dochody ogółem		4,129,927
KOSZTY		
Opłaty za zarządzanie	5	2,726,295
Opłaty na rzecz depozytariusza	7	11,868
Odsetki bankowe netto	3.12	1,143
Odsetki netto od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
Podatek roczny	8	101,085
Amortyzacja wydatków na utworzenie subfunduszy	3.11	-
Koszty audytu i prawne		9,289
Koszty administracyjne	7	102,422
Inne koszty		174,794
Koszty ogółem		3,126,896

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres kończący się 30 czerwca 2024 roku

SANTANDER GO
GLOBAL EQUITY ESG
USD

	Noty	
Zysk/(strata) netto z inwestycji		1,003,031
Zrealizowany zysk/(strata) netto z tytułu:		
- inwestycji	3.2	5,586,124
- operacji walutowych	3.3	(83,221)
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	(8,476,186)
- kontraktów futures	3.5	-
- opcji	3.6	-
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
Zrealizowany zysk/(strata) netto za okres		(2,973,283)
Zmiana niezrealizowanego zysku/(straty) z tytułu:		
- inwestycji	3.2	78,205,717
- operacji walutowych	3.3	(7,180)
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	(2,726,364)
- kontraktów futures	3.5	-
- opcji	3.6	-
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
Zmiana niezrealizowanego zysku/(straty) w okresie		75,472,173
Zysk/(strata) netto z operacji		73,501,921
Nabycia	4	112,711,802
Umorzenia	4	(58,841,243)
Wyłacone dywidendy	2	-
Wartość Aktywów Netto na koniec okresu		687,952,641

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres kończący się 30 czerwca 2024 roku

	Noty	SANTANDER GO DYNAMIC BOND USD
Wartość Aktywów Netto na początek okresu		120,291,356
DOCHODY		
Dywidendy netto	3.12	-
Odsetki z tytułu obligacji netto	3.12	1,725,750
Odsetki bankowe netto	3.12	72,213
Umowa odkupu	3.10, 17	299,135
Odsetki netto od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	265,611
Inne dochody		-
Dochody ogółem		2,362,709
KOSZTY		
Opłaty za zarządzanie	5	459,040
Opłaty na rzecz depozytariusza	7	58,169
Odsetki bankowe netto	3.12	180
Odsetki netto od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	252,506
Podatek roczny	8	15,926
Amortyzacja wydatków na utworzenie subfunduszy	3.11	-
Koszty audytu i prawne		9,205
Koszty administracyjne	7	67,453
Inne koszty		70,756
Koszty ogółem		933,235

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres kończący się 30 czerwca 2024 roku

SANTANDER GO DYNAMIC BOND

	Noty	USD
Zysk/(strata) netto z inwestycji		1,429,474
Zrealizowany zysk/(strata) netto z tytułu:		
- inwestycji	3.2	(393,123)
- operacji walutowych	3.3	(343,595)
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	(1,988,751)
- kontraktów futures	3.5	717,173
- opcji	3.6	134,221
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	(258,754)
Zrealizowany zysk/(strata) netto za okres		(2,132,829)
Zmiana niezrealizowanego zysku/(straty) z tytułu:		
- inwestycji	3.2	(609,480)
- operacji walutowych	3.3	(9,890)
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	346,272
- kontraktów futures	3.5	1,100,828
- opcji	3.6	13,783
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	290,840
Zmiana niezrealizowanego zysku/(straty) w okresie		1,132,353
Zysk/(strata) netto z operacji		428,998
Nabycia	4	17,281,140
Umorzenia	4	(17,252,493)
Wyłacone dywidendy	2	-
Wartość Aktywów Netto na koniec okresu		120,749,001

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres kończący się 30 czerwca 2024 roku

	Noty	SANTANDER FUTURE WEALTH USD
Wartość Aktywów Netto na początek okresu		85,517,854
DOCHODY		
Dywidendy netto	3.12	50,344
Odsetki z tytułu obligacji netto	3.12	-
Odsetki bankowe netto	3.12	28,916
Umowy odkupu	3.10, 17	
Odsetki netto od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
Inne dochody		189
Dochody ogółem		79,449
KOSZTY		
Opłaty za zarządzanie	5	315,931
Opłaty na rzecz depozytariusza	7	4,845
Odsetki bankowe netto	3.12	374
Odsetki netto od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
Podatek roczny	8	4,248
Amortyzacja wydatków na utworzenie subfunduszy	3.11	-
Koszty audytu i prawne		9,953
Koszty administracyjne	7	25,516
Inne koszty		40,712
Koszty ogółem		401,579

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres kończący się 30 czerwca 2024 roku

		SANTANDER FUTURE WEALTH
		USD
Zysk/(strata) z inwestycji	Noty	(322,130)
Zrealizowany zysk/(strata) netto z tytułu:		
- inwestycji	3.2	(209,652)
- operacji walutowych	3.3	(54,143)
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	(528,200)
- kontraktów futures	3.5	321,530
- opcji	3.6	-
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
Zrealizowany zysk/(strata) netto za okres		(470,465)
Zmiana niezrealizowanego zysku/(straty) z tytułu:		
- inwestycji	3.2	5,071,834
- operacji walutowych	3.3	(27,156)
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	(190,120)
- kontraktów futures	3.5	(72,610)
- opcji	3.6	(3,280)
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
Zmiana niezrealizowanego zysku/(straty) w okresie		4,778,668
Zysk/(strata) netto z operacji		3,986,073
Nabycia	4	2,886,775
Umorzenia	4	(15,004,256)
Wyłacone dywidendy	2	-
Wartość Aktywów Netto na koniec okresu		77,386,446

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres kończący się 30 czerwca 2024 roku

	Noty	SANTANDER PROSPERITY USD
Wartość Aktywów Netto na początek okresu		51,642,863
DOCHODY		
Dywidendy netto	3.12	584,661
Odsetki z tytułu obligacji netto	3.12	-
Odsetki bankowe netto	3.12	25,180
Umowy odkupu	3.10, 17	
Odsetki netto od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
Inne dochody		233
Dochody ogółem		610,074
KOSZTY		
Opłaty za zarządzanie	5	184,981
Opłaty na rzecz depozytariusza	7	1,030
Odsetki bankowe netto	3.12	-
Odsetki netto od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
Podatek roczny	8	6,006
Amortyzacja wydatków na utworzenie subfunduszy	3.11	-
Koszty audytu i prawne		6,596
Koszty administracyjne	7	6,226
Inne koszty		48,553
Koszty ogółem		253,392

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres kończący się 30 czerwca 2024 roku

	Noty	SANTANDER PROSPERITY USD
Zysk/(strata) z inwestycji		356,682
Zrealizowany zysk/(strata) netto z tytułu:		
- inwestycji	3.2	61,204
- operacji walutowych	3.3	(39,276)
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	(52,260)
- kontraktów futures	3.5	-
- opcji	3.6	-
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
Zrealizowany zysk/(strata) netto za okres		(30,332)
Zmiana niezrealizowanego zysku/(straty) z tytułu:		
- inwestycji	3.2	414,324
- operacji walutowych	3.3	(24,043)
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	(15,887)
- kontraktów futures	3.5	-
- opcji	3.6	-
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
Zmiana niezrealizowanego zysku/(straty) w okresie		374,394
Zysk/(strata) netto z operacji		700,744
Nabycia	4	5,141,882
Umorzenia	4	(5,314,693)
Wyłacone dywidendy	2	-
Wartość Aktywów Netto na koniec okresu		52,170,796

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres kończący się 30 czerwca 2024 roku

		SANTANDER US EQUITY ESG USD
	Noty	
Wartość Aktywów Netto na początek okresu		11,228,826
DOCHODY		
Dywidendy netto	3.12	73,874
Odsetki z tytułu obligacji netto	3.12	-
Odsetki bankowe netto	3.12	18,607
Umowy odkupu	3.10, 17	-
Odsetki netto od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
Inne dochody		-
Dochody ogółem		92,481
KOSZTY		
Opłaty za zarządzanie	5	16,113
Opłaty na rzecz depozytariusza	7	1,362
Odsetki bankowe netto	3.12	136
Odsetki netto od kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
Podatek roczny	8	2,054
Amortyzacja wydatków na utworzenie subfunduszy	3.11	-
Koszty audytu i prawne		25,569
Koszty administracyjne	7	20,669
Inne koszty		11,202
Koszty ogółem		77,105

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie operacji i zmian stanu aktywów netto za okres kończący się 30 czerwca 2024 roku

		SANTANDER US EQUITY ESG
	Noty	USD
Zysk/(strata) netto z inwestycji		15,376
Zrealizowany zysk/(strata) netto z tytułu:		
- inwestycji	3.2	128,273
- operacji walutowych	3.3	361
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	(4,387)
- kontraktów futures	3.5	68,404
- opcji	3.6	-
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
Zrealizowany zysk/(strata) netto za okres		192,651
Zmiana niezrealizowanego zysku/(straty) z tytułu:		
- inwestycji	3.2	2,160,627
- operacji walutowych	3.3	(1,521)
- terminowych kontraktów walutowych	3.4	726
- kontraktów futures	3.5	(8,553)
- opcji	3.6	-
- kontraktów swap	3.7, 3.8, 3.9	-
Zmiana niezrealizowanego zysku/(straty) w okresie		2,151,279
Zysk/(strata) netto z operacji		2,359,306
Nabycia	4	6,142,195
Umorzenia	4	(965,857)
Wyłacone dywidendy	2	-
Wartość Aktywów Netto na koniec okresu		18,764,470

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Dane statystyczne (c.d.)

SANTANDER AM EURO EQUITY

		30 czerwca 2024	31 grudnia 2023	31 grudnia 2022
Wartość Aktywów Netto	EUR	430,431,459	437,156,070	442,781,067
Klasa A				
Liczba wyemitowanych tytułów		171,619.43	188,877.69	203,120.78
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	208.51	195.88	173.51
Klasa AU				
Liczba wyemitowanych tytułów		1,183.80	2,286.57	2,458.63
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	123.50	119.88	103.10
Klasa B				
Liczba wyemitowanych tytułów		22,247.55	21,598.72	34,725.82
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	154.24	144.54	127.39
Klasa I				
Liczba wyemitowanych tytułów		7,309.80	7,187.47	8,352.71
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	2,017.13	1,881.44	1,642.75
Klasa IKP *				
Liczba wyemitowanych tytułów		-	3,782.94	6,792.94
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	GBP	-	2,263.48	2,016.48
Klasa M				
Liczba wyemitowanych tytułów		2,704,973.68	2,885,194.25	3,325,529.61
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	139.13	129.41	112.38

* Zobacz notę nr 1

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG

30 czerwca 2024

31 grudnia 2023

31 grudnia 2022

Wartość Aktywów Netto	USD	687,952,641	526,393,923	681,950,942
Klasa A				
Liczba wyemitowanych tytułów		21,968.63	25,363.05	39,276.89
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	145.94	103.03	129.63
Klasa AE				
Liczba wyemitowanych tytułów		491,613.51	398,290.08	250,156.68
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	212.31	150.52	177.74
Klasa AEH				
Liczba wyemitowanych tytułów		4,032.58	10.00	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł		111.96	81.36	-
Klasa B				
Liczba wyemitowanych tytułów		180,601.11	237,615.06	430,165.19
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	149.03	104.58	131.06
Klasa BE				
Liczba wyemitowanych tytułów		561,624.46	617,359.78	383,711.76
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	215.98	152.21	179.01
Klasa BEH				
Liczba wyemitowanych tytułów		329,187.65	342,150.53	187,677.74
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	136.01	98.53	127.41
Klasa I				
Liczba wyemitowanych tytułów		577,035.19	581,819.41	66,538.06
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	152.22	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	151.59	109.37	122.00
Klasa M				
Liczba wyemitowanych tytułów		956,344.74	1,608,162.62	2,055,769.79
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	156.85	108.86	135.25
Klasa RKP				
Liczba wyemitowanych tytułów		17,269,637.03	8,077,885.32	4,908,981.26
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	GBP	1.67	1.21	1.35
Klasa SE				
Liczba wyemitowanych tytułów		42,855.14	17,064.48	2,992.74
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	142.84	99.77	116.62
Klasa V				
Liczba wyemitowanych tytułów		354,798.32	497,644.36	968,694.14
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	220.14	151.83	166.22

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Dane statystyczne (c.d.)

SANTANDER GO DYNAMIC BOND

		30 czerwca 2024	31 grudnia 2023	31 grudnia 2022
Wartość Aktywów Netto	USD	120,749,001	128,367,306	251,406,613.67
Klasa A				
Liczba wyemitowanych tytułów		30,583.77	21,602.66	14,555.72
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	99.93	92.85	102.95
Klasa B				
Liczba wyemitowanych tytułów		154,659.42	228,288.64	471,184.13
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	101.55	93.86	103.71
Klasa BEH				
Liczba wyemitowanych tytułów		328,337.49	383,299.57	302,821.64
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	92.10	87.46	98.74
Klasa I				
Liczba wyemitowanych tytułów		51.77	51.77	463,190.00
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	104.95	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	93.85	88.22	99.00
Klasa M				
Liczba wyemitowanych tytułów		345,435.32	376,904.30	700,372.44
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	100.72	91.89	100.65
Klasa MEH				
Liczba wyemitowanych tytułów		327,400.31	349,440.48	395,483.80
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	94.11	88.25	98.83
Klasa RKP				
Liczba wyemitowanych tytułów		1,408.28	1,147.80	76.56
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	GBP	107.37	103.29	101.09

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Dane statystyczne (c.d.)

SANTANDER FUTURE WEALTH

		30 czerwca 2024	31 grudnia 2023	31 grudnia 2022
Wartość Aktywów Netto	USD	77,386,446	103,707,094	228,961,238
Klasa A				
Liczba wyemitowanych tytułów		257,979.88	419,436.26	892,726.56
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	87.21	74.25	101.83
Klasa AE				
Liczba wyemitowanych tytułów		159,736.50	226,937.33	221,950.09
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	98.98	84.63	108.93
Klasa AEH				
Liczba wyemitowanych tytułów		3,526.39	50.00	50.00
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	77.32	68.03	96.72
Klasa APH				
Liczba wyemitowanych tytułów		1,629.55	875.64	50.00
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	GBP	81.41	70.09	98.51
Klasa M				
Liczba wyemitowanych tytułów		101,412.68	161,897.11	321,787.30
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	90.52	75.54	102.24
Klasa RKP				
Liczba wyemitowanych tytułów		711.35	965.14	508.04
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	GBP	97.61	86.36	104.42
Klasa V				
Liczba wyemitowanych tytułów		55,708.09	133,940.14	279,603.21
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	93.16	77.83	93.63
Klasa X				
Liczba wyemitowanych tytułów		122,108.51	246,966.50	385,843.23
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	89.40	74.83	101.48
Klasa XE				
Liczba wyemitowanych tytułów		107,888.07	114,475.90	96,116.27
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	104.74	88.04	112.06

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Dane statystyczne (c.d.)

SANTANDER PROSPERITY

		30 czerwca 2024	31 grudnia 2023	31 grudnia 2022
Wartość Aktywów Netto	USD	52,170,796	51,642,863	22,415,838
Klasa A				
Liczba wyemitowanych tytułów		37,299.58	31,617.33	60.00
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	116.96	115.41	100.21
Klasa AE				
Liczba wyemitowanych tytułów		95,405.63	87,029.90	3,520.85
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	111.13	106.39	95.61
Klasa AEH				
Liczba wyemitowanych tytułów		10,323.24	14,473.13	949.38
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	112.50	112.03	99.78
Klasa I				
Liczba wyemitowanych tytułów		199,656.00	199,656.00	199,656.00
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	118.50	116.47	100.33
Klasa IE				
Liczba wyemitowanych tytułów		137.73	187.73	18,404.81
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	114.27	108.97	97.14
Klasa M				
Liczba wyemitowanych tytułów		9,909.43	11,232.73	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	GBP	1,145.94	1,125.88	-
Klasa RKP				
Liczba wyemitowanych tytułów		1,221.99	372.21	84.69
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	GBP	109.39	106.65	97.42

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER US EQUITY ESG

		30 czerwca 2024	31 grudnia 2023	31 grudnia 2022
Wartość Aktywów Netto	USD	18,764,470	11,228,826	-
Klasa A				
Liczba wyemitowanych tytułów		2,062.83	50.00	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	125.80	108.12	-
Klasa AE				
Liczba wyemitowanych tytułów		50.00	50.00	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	127.65	106.42	-
Klasa AEH				
Liczba wyemitowanych tytułów		1,905.80	50.00	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	EUR	123.56	107.03	-
Klasa M				
Liczba wyemitowanych tytułów		45,318.31	3,350.86	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	122.68	104.91	-
Klasa S				
Liczba wyemitowanych tytułów		100,000.00	100,000.00	-
Wartość Aktywów Netto na 1 tytuł	USD	126.86	108.60	-

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER AM EURO EQUITY

Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2024 r.

Opis	Waluta	Ilość	Koszt EUR	Wartość rynkowa EUR	% WAN
<u>Zbywalne papiery wartościowe dopuszczone do oficjalnego notowania na giełdzie lub znajdujące się w obrocie na innym rynku regulowanym - ogółem</u>					
<i>Akcje</i>					
<i>Francja</i>					
ACCOR SA COMMON STOCK	EUR	146,802	6,102,687	5,622,517	1.31%
AIR LIQUIDE SA COMMON	EUR	57,328	7,279,102	9,245,860	2.15%
AXA SA COMMON STOCK EUR	EUR	341,303	9,274,630	10,433,633	2.42%
BNP PARIBAS SA COMMON	EUR	75,867	5,373,512	4,516,363	1.05%
CIE GENERALE DES	EUR	120,671	3,025,755	4,357,430	1.01%
ESSILORLUXOTTICA SA	EUR	24,053	3,534,761	4,839,464	1.12%
FAURECIA SE COMMON STOCK	EUR	164,087	3,688,449	1,813,982	0.42%
GETLINK SE COMMON STOCK EUR 0.4	EUR	163,399	2,606,253	2,524,515	0.59%
L'OREAL SA COMMON STOCK	EUR	10,298	4,321,352	4,222,695	0.98%
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	EUR	24,852	9,857,142	17,734,387	4.12%
PUBLICIS GROUPE SA	EUR	68,796	2,869,254	6,836,946	1.59%
SANOFI COMMON STOCK EUR	EUR	158,166	12,771,001	14,225,450	3.30%
SCHNEIDER ELECTRIC SE	EUR	70,067	10,346,090	15,716,028	3.65%
SPIE SA COMMON STOCK EUR	EUR	125,822	3,725,762	4,250,267	0.99%
TOTALENERGIES SE COMMON	EUR	126,321	5,780,732	7,873,588	1.83%
VINCI SA COMMON STOCK	EUR	108,526	9,490,737	10,676,788	2.48%
Francja razem			100,047,219	124,889,913	29.01%
<i>Niemcy</i>					
ADIDAS AG COMMON STOCK	EUR	30,798	7,837,136	6,867,954	1.60%
ALLIANZ SE COMMON STOCK	EUR	44,696	9,886,734	11,598,612	2.69%
DAIMLER AG COMMON STOCK	EUR	73,388	4,644,511	4,738,663	1.10%
DEUTSCHE POST AG COMMON	EUR	191,435	6,341,544	7,234,329	1.68%
DEUTSCHE TELEKOM AG	EUR	509,832	7,785,985	11,970,855	2.78%
E.ON SE COMMON STOCK EUR	EUR	531,013	6,566,054	6,507,564	1.51%
FRESENIUS SE & CO KGAA	EUR	109,068	3,219,358	3,040,816	0.71%
HEIDELBERGCEMENT AG	EUR	49,000	4,702,736	4,744,180	1.10%
INFINEON TECHNOLOGIES AG	EUR	155,514	4,592,006	5,334,908	1.24%
MUENCHENER	EUR	22,605	6,652,183	10,556,535	2.45%
SAP SE COMMON STOCK EUR	EUR	102,853	12,431,708	19,492,700	4.54%
SIEMENS AG COMMON STOCK	EUR	46,867	5,739,558	8,141,735	1.89%
VONOVIA SE COMMON STOCK	EUR	173,916	4,671,988	4,617,470	1.07%
Niemcy razem			85,071,501	104,846,321	24.36%
<i>Irlandia</i>					
LINDE PLC	EUR	18,713	3,717,733	7,679,815	1.78%
Irlandia razem			3,717,733	7,679,815	1.78%
<i>Włochy</i>					

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

ENEL SPA COMMON STOCK	EUR	1,328,209	7,720,996	8,625,389	2.00%
ENI SPA COMMON STOCK EUR	EUR	494,209	7,062,694	7,093,876	1.65%
INTESA SANPAOLO SPA	EUR	2,641,023	6,286,108	9,166,991	2.13%
UNICREDIT SPA COMMON	EUR	267,649	4,510,118	9,261,994	2.15%
Włochy razem			<u>25,579,916</u>	<u>34,148,250</u>	<u>7.93%</u>
<i>Hiszpania</i>					
BANCO SANTANDER SA	EUR	2,514,235	9,322,050	10,887,895	2.53%
CELLNEX TELECOM SA	EUR	163,678	7,144,121	4,970,901	1.15%
IBERDROLA SA COMMON	EUR	797,397	8,859,700	9,660,465	2.24%
INDUSTRIA DE DISEÑO	EUR	224,856	5,817,577	10,424,324	2.42%
PUIG BRANDS SA COMMON STOCK EUR 0.06	EUR	124,364	3,046,918	3,245,900	0.75%
Hiszpania razem			<u>34,190,366</u>	<u>39,189,485</u>	<u>9.09%</u>
<i>Szwajcaria</i>					
DSM-FIRMENICH AG COMMON	CHF	63,137	7,209,001	6,667,267	1.55%
Szwajcaria razem			<u>7,209,001</u>	<u>6,667,267</u>	<u>1.55%</u>
<i>Holandia</i>					
ADYEN NV COMMON STOCK	EUR	1,806	2,172,779	2,010,439	0.47%
AIRBUS SE COMMON STOCK	EUR	87,503	9,463,827	11,223,135	2.61%
ASML HOLDING NV COMMON	EUR	40,470	17,719,916	39,021,173	9.08%
HEINEKEN NV COMMON STOCK	EUR	50,558	4,183,982	4,565,387	1.06%
ING GROEP NV COMMON	EUR	760,272	7,782,039	12,135,462	2.82%
STELLANTIS NV COMMON	EUR	327,464	4,410,451	6,050,225	1.41%
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	EUR	209,940	5,136,673	5,832,133	1.35%
Holandia razem			<u>50,869,667</u>	<u>80,837,954</u>	<u>18.80%</u>
<i>Wielka Brytania</i>					
COCA-COLA EUROPACIFIC	EUR	96,146	5,167,084	6,576,386	1.53%
SHELL PLC COMMON STOCK	EUR	172,907	3,479,113	5,808,811	1.35%
Wielka Brytania razem			<u>8,646,197</u>	<u>12,385,197</u>	<u>2.88%</u>
Akcje ogółem			<u>315,331,600</u>	<u>410,644,202</u>	<u>95.40%</u>
Zbywalne papiery wartościowe dopuszczone do oficjalnego notowania na giełdzie lub znajdujące się w obrocie na innym rynku regulowanym - ogółem					
			<u>315,331,600</u>	<u>410,644,202</u>	<u>95.40%</u>
Inwestycje ogółem			<u>315,331,600</u>	<u>410,644,202</u>	<u>95.40%</u>

Klasyfikacja geograficzna inwestycji na dzień 30 czerwca 2024 r.

	% WAN
Francja	29.01%
Niemcy	24.36%
Holandia	18.80%
Hiszpania	9.09%
Włochy	7.93%
Wielka Brytania	2.88%
Irlandia	1.78%
Szwajcaria	1.55%
	95.40%

Ekonomiczna klasyfikacja inwestycji na dzień 30 czerwca 2024 r.

	% WAN
Bankowość	10.68%
Komponenty elektroniczne	10.32%
Ubezpieczenia	7.56%
Tekstylnia/odzież	6.84%
Narzędzia	5.75%
Zdrowie/osobiste	5.74%
Substancje chemiczne	5.48%
Przetwarzanie danych	5.01%
Zróżdła energii	4.83%
Samochody	3.94%
Różne	3.93%
Telekomunikacja	3.93%
Elektryka i elektronika	3.65%
Lotnictwo	2.61%
Budownictwo (mieszaniowe)	2.48%
Handel	2.42%
Komponenty przemysłowe	1.89%
Transport (lotniczy)	1.68%
Żywność/gospodarstwo domowe	1.53%
Wypoczynek / turystyka	1.31%
Materiały budowlane	1.10%
Nieruchomości	1.07%
Napoje/wyroby tytoniowe	1.06%
Transport (drogowy/kolejowy)	0.59%
Razem	95.40%

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG**Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2024**

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					
Australia					
FORTESCUE METALS GROUP	AUD	593,578	10,142,871	8,487,375	1.23%
Australia razem			10,142,871	8,487,375	1.23%
Dania					
NOVO NORDISK A/S COMMON	DKK	66,708	6,755,960	9,640,649	1.40%
Dania razem			6,755,960	9,640,649	1.40%
Francja					
LVMH MOET HENNESSY LOUIS	EUR	8,852	8,178,223	6,770,017	0.98%
SCHNEIDER ELECTRIC SE	EUR	53,660	8,827,260	12,899,517	1.88%
TOTAL ENERGIES SE COMMON	EUR	92,249	6,724,524	6,162,434	0.90%
Francja razem			23,730,007	25,831,968	3.76%
Niemcy					
ALLIANZ SE COMMON STOCK	EUR	42,959	10,645,858	11,947,720	1.74%
DAIMLER AG COMMON STOCK	EUR	101,144	7,835,225	6,999,458	1.02%
DEUTSCHE BOERSE AG	EUR	35,003	6,078,444	7,169,014	1.04%
DEUTSCHE TELEKOM AG	EUR	308,069	7,699,915	7,752,461	1.13%
Niemcy razem			32,259,442	33,868,653	4.93%
Irlandia					
ACCENTURE PLC COMMON	USD	22,369	7,397,775	6,786,978	0.99%
LINDE PLC	USD	28,553	8,774,488	11,851,722	1.69%
LINDE PLC	EUR	925	261,349	408,858	0.06%
TRANE TECHNOLOGIES PLC	USD	41,882	8,587,529	13,776,246	2.00%
Irlandia razem			25,021,141	32,621,804	4.74%
Izrael					
CHECK POINT SOFTWARE	USD	75,988	10,885,903	12,538,020	1.82%
Izrael razem			10,885,903	12,538,020	1.82%
Japonia					
HITACHI LTD COMMON STOCK	JPY	778,000	11,523,443	17,416,250	2.53%
KEYENCE CORP COMMON	JPY	12,700	5,333,809	5,569,968	0.81%
SONY GROUP CORP COMMON	JPY	62,300	6,056,350	5,282,681	0.77%
SUMITOMO MITSUI	JPY	116,400	6,945,246	7,760,724	1.13%
Japonia razem			29,858,848	36,029,623	5.24%
Holandia					
SCHLUMBERGER NV COMMON	USD	155,383	9,101,599	7,330,970	1.07%
Holandia razem			9,101,599	7,330,970	1.07%

Informacje dodatkowe stanowią integralną część niniejszych sprawozdań finansowych

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Szwajcaria					
UBS GROUP AG COMMON	CHF	263,672	7,138,467	7,761,100	1.13%
Szwajcaria razem			7,138,467	7,761,100	1.13%
Wielka Brytania					
ASTRAZENECA PLC COMMON	GBP	119,163	15,390,455	18,612,331	2.71%
HALEON PLC COMMON STOCK	GBP	2,638,005	10,451,781	10,757,749	1.56%
RELX PLC COMMON STOCK	GBP	362,678	11,487,608	16,683,405	2.43%
Wielka Brytania razem			37,329,844	46,053,485	6.70%
Stany Zjednoczone					
ABBVIE INC COMMON STOCK	USD	83,871	13,286,219	14,385,554	2.09%
ADVANCED MICRO DEVICES	USD	26,818	2,321,228	4,350,148	0.63%
ALPHABET INC COMMON STOCK	USD	192,480	23,659,909	35,060,232	5.10%
AMAZON.COM INC COMMON	USD	143,541	21,760,291	27,739,298	4.03%
APPLE INC COMMON STOCK	USD	144,887	22,774,141	30,516,100	4.44%
AUTOZONE INC COMMON	USD	3,827	8,456,107	11,343,611	1.65%
BANK OF AMERICA CORP	USD	367,909	12,545,847	14,631,741	2.13%
BOOKING HOLDINGS INC	USD	3,506	13,151,519	13,889,019	2.02%
BROADCOM INC COMMON	USD	11,325	12,313,717	18,182,627	2.64%
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC COMMON STOCK USD 0.01	USD	17,247	4,864,410	5,307,764	0.77%
CBRE GROUP INC COMMON	USD	67,736	5,791,314	6,035,955	0.88%
CHENIERE ENERGY INC	USD	62,058	8,855,182	10,849,600	1.58%
COSTCO WHOLESALE CORP	USD	15,659	7,956,413	13,309,993	1.93%
DELL TECHNOLOGIES INC	USD	87,907	10,533,060	12,123,254	1.76%
ELI LILLY & CO COMMON	USD	21,210	7,466,055	19,203,110	2.79%
FORTINET INC COMMON	USD	96,422	5,825,931	5,811,354	0.84%
HOME DEPOT INC/THE	USD	29,562	9,135,137	10,176,423	1.48%
JPMORGAN CHASE & CO	USD	103,290	15,784,621	20,891,435	3.04%
MARSH & MCLENNAN COS INC	USD	67,931	10,937,143	14,314,420	2.08%
META PLATFORMS INC	USD	43,839	12,371,845	22,104,501	3.21%
MICROSOFT CORP COMMON	USD	91,149	26,731,463	40,739,046	5.92%
MOTOROLA SOLUTIONS INC	USD	19,093	4,914,717	7,370,853	1.07%
NVIDIA CORP COMMON STOCK	USD	278,371	9,428,760	34,389,953	4.98%
S&P GLOBAL INC COMMON	USD	12,926	5,264,938	5,764,996	0.84%
THERMO FISHER SCIENTIFIC	USD	29,149	15,647,538	16,119,397	2.34%
UNION PACIFIC CORP	USD	31,529	7,108,268	7,133,752	1.04%
UNITEDHEALTH GROUP INC	USD	21,047	9,807,525	10,718,395	1.56%
VISA INC COMMON STOCK	USD	73,734	16,282,802	19,352,963	2.81%
WATERS CORP COMMON STOCK	USD	18,878	6,069,985	5,476,885	0.80%
Stany Zjednoczone razem			331,046,085	457,292,379	66.45%
Akcje ogółem			523,270,167	677,456,026	98.47%
Zbywalne papiery wartościowe dopuszczone do oficjalnego notowania na giełdzie lub znajdujące się w obrocie na innym rynku regulowanym - ogółem			523,270,167	677,456,026	98.47%
Inwestycje ogółem			523,270,167	677,456,026	98.47%

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Klasyfikacja geograficzna inwestycji na dzień 30 czerwca 2024 r.

	% WAN
Stany Zjednoczone	66.45%
Wielka Brytania	6.70%
Japonia	5.24%
Niemcy	4.93%
Irlandia	4.74%
Francja	3.76%
Izrael	1.82%
Dania	1.40%
Australia	1.23%
Szwajcaria	1.13%
Antyle Holenderskie	1.07%
Razem	98.47%

Ekonomiczna klasyfikacja inwestycji na dzień 30 czerwca 2024 r.

	% WAN
Przetwarzanie danych	13.15%
Elektryczne i elektronika	12.29%
Zdrowie/osobiste	12.11%
Różne	10.74%
Komponenty elektroniczne	9.06%
Handel	7.16%
Bankowość	6.30%
Ubezpieczenia	3.82%
Zróżna energia	3.55%
Usługi finansowe	3.01%
Komponenty przemysłowe	2.53%
Wypoczynek/turystyka	2.02%
Materiały budowlane	2.00%
Żywność/gospodarstwo domowe	1.93%
Przemysł chemiczny	1.75%
Metalurgia - stal	1.23%
Telekomunikacja	1.13%
Transport (drogowy/kolejowy)	1.04%
Samochody	1.02%
Tekstylna/odzież	0.98%
Nieruchomości	0.88%
Urządzenia	0.77%
Total	98.47%

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER GO DYNAMIC BOND

Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2024

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					
<i>AUSTRALIA</i>					
SANTOS 3.649% 04/31	USD	200,000	198,940	174,965	0.14%
SANTOS FINANCE LTD 3.649% 04/31	USD	200,000	201,182	174,965	0.14%
TOTAL AUSTRALIA			400,122	349,930	0.28%
Belgia					
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV CALLABLE MEDIUM TERM	EUR	300,000	325,604	320,381	0.27%
TOTAL BELGIUM			325,604	320,381	0.27%
Bermudy					
MARVELL 2.95% 04/31	USD	800,000	803,376	690,363	0.57%
TOTAL BERMUDA			803,376	690,363	0.57%
Kanada					
AIR CANADA 4.625% 08/29	CAD	100,000	79,580	71,040	0.06%
BROOKFIELD 4.7% 09/47	USD	200,000	227,961	169,590	0.14%
TOTAL CANADA			307,541	240,630	0.20%
Kajmany					
APIDOS CLO XV FLT 6.687% 04/31	USD	841,345	841,943	842,223	0.70%
ATLAS SENIOR FLT 6.805% 01/30	USD	275,453	275,508	275,659	0.23%
AVOLON 2.528% 11/27	USD	457,000	472,741	411,257	0.34%
SANDS CHINA 5.65% 08/28	USD	300,000	339,570	293,926	0.24%
WYNN MACAU 5.625% 08/28	USD	600,000	606,750	563,097	0.47%
TOTAL CAYMAN ISLANDS			2,536,512	2,386,162	1.98%
Francja					
ALTAREA SCA 1.875% 01/28	EUR	100,000	111,449	97,209	0.08%
ALTICE FRANCE 5.5% 10/29	USD	200,000	200,000	132,093	0.11%
ALTICE FRANCE SA 4.25% 10/29	EUR	200,000	234,270	142,923	0.12%
BNP PARIBAS SA CALLABLE NOTES VARIABLE USD 1000	USD	200,000	202,680	201,246	0.17%
BNP PARIBAS SA VAR 1.904% 09/28	USD	200,000	202,952	178,706	0.15%
BNP PARIBAS SA VAR 2.159% 09/29	USD	400,000	400,000	349,245	0.29%
BNP PARIBAS SA VAR 3.052% 01/31	USD	400,000	416,884	350,516	0.29%
BPCE SA VAR 2.125% 10/46	EUR	200,000	230,890	175,175	0.15%
ELECTRICITE DE FRANCE SA CALLABLE MEDIUM TERM NOTE	EUR	200,000	214,115	216,233	0.18%
HOLDING 0.125% 09/25	EUR	100,000	117,907	102,007	0.08%
HOLDING 0.625% 09/28	EUR	200,000	235,802	182,634	0.15%
MUTUELLE ASSURANCE VAR 2.125% 06/52	EUR	200,000	240,754	170,141	0.14%
TOTAL FRANCE			2,807,703	2,298,128	1.91%

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2024

Niemcy

DEUTSCHE BANK AG 1.625% 01/27	EUR	100,000	110,683	101,465	0.08%
DEUTSCHE BANK AG 2.625% 12/24	GBP	100,000	129,961	124,697	0.10%
DEUTSCHE BANK AG VAR 6% 12/49	USD	200,000	200,056	190,308	0.16%
DEUTSCHE BANK VAR 2.129% 11/26	USD	200,000	203,733	189,864	0.16%
DEUTSCHE BANK VAR 3.729% 01/32	USD	200,000	199,220	168,707	0.14%
INEOS 2.25% 01/27	EUR	100,000	118,861	100,745	0.08%
SCHAEFFLER AG CALLABLE MEDIUM TERM NOTE FIXED 4.5%	EUR	200,000	215,825	212,140	0.18%
VOLKSWAGEN 0.875% 02/25	GBP	100,000	136,503	123,058	0.10%
VOLKSWAGEN 1.875% 12/24	GBP	300,000	392,765	373,745	0.31%
TOTAL GERMANY			1,707,607	1,584,729	1.31%

Hong Kong

MELCO 5.375% 12/29	USD	200,000	200,000	179,604	0.15%
TOTAL HONG KONG			200,000	179,604	0.15%

Irlandia

AERCAP 3.3% 01/32	USD	400,000	398,496	343,810	0.28%
BLACK DIAMOND FLT 4.853% 01/32	EUR	842,354	1,019,038	902,851	0.75%
CARLYLE GLOBAL FLT 4.715% 07/30	EUR	250,000	274,527	267,929	0.22%
EURO-GALAXY VI FLT 4.693% 04/31	EUR	533,956	582,879	571,505	0.47%
OAK HILL FLT 4.723% 01/32	EUR	342,541	407,842	366,521	0.30%
PERRIGO 4.65% 06/30	USD	200,000	214,130	184,054	0.15%
TOTAL IRELAND			2,896,912	2,636,670	2.17%

Włochy

AMCO - ASSET 2.25% 07/27	EUR	100,000	113,685	101,618	0.08%
ATLANTIA 1.875% 02/28	EUR	600,000	719,557	590,789	0.49%
BANCA MONTE VAR 6.75% 03/26	EUR	200,000	211,930	216,766	0.18%
INTESA SANPAOLO 5.148% 06/30	GBP	100,000	125,965	116,849	0.10%
INTESA SANPAOLO SPA VAR 7.75% 12/49	EUR	200,000	296,680	220,284	0.18%
TOTAL ITALY			1,467,817	1,246,306	1.03%

Japonia

MIZUHO 2.564% 09/31	USD	500,000	500,000	407,034	0.34%
MIZUHO 3.477% 04/26	USD	200,000	210,460	193,670	0.16%
NISSAN 2.652% 03/26	EUR	100,000	130,860	104,936	0.09%
NISSAN 4.345% 09/27	USD	600,000	641,168	573,107	0.47%
NOMURA 3.103% 01/30	USD	900,000	952,513	795,987	0.66%
TOTAL JAPAN			2,435,001	2,074,734	1.72%

Jersey

TP ICAP 2.625% 11/28	GBP	200,000	267,950	216,972	0.18%
TOTAL JERSEY			267,950	216,972	0.18%

Luksemburg

ADLER GROUP 5% 04/27	EUR	300,000	356,478	103,711	0.09%
ALTICE 3% 01/28	EUR	100,000	97,489	83,211	0.07%
AROUNDTOWN 0.375% 04/27	EUR	600,000	663,350	558,451	0.46%
BEVCO LUX SARL 1% 01/30	EUR	600,000	723,760	548,186	0.45%
CBRE GLOBAL INVESTORS OPEN-ENDED FUNDS SCA	EUR	300,000	325,467	326,120	0.27%
CROMWELL 2.125% 11/25	EUR	400,000	498,342	412,354	0.34%
TOTAL LUXEMBOURG			2,664,886	2,032,033	1.68%

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2024

Meksyk					
PETROLEOS MEXICANOS 10% 02/33	USD	100,000	97,700	100,427	0.08%
TOTAL MEXICO			97,700	100,427	0.08%
Rumunia					
GLOBALWORTH REAL ESTATE INVESTMENTS LTD CALLABLE	EUR	94,000	91,226	94,306	0.08%
TOTAL ROMANIA			91,226	94,306	0.08%
Ponadnarodowy					
DELTA AIR 4.5% 10/25	USD	50,004	50,004	49,408	0.04%
TOTAL SUPRANATIONAL			50,004	49,408	0.04%
Szwecja					
BALDER FINLAND 1% 01/29	EUR	200,000	242,236	176,350	0.15%
SAGAX EURO 0.75% 01/28	EUR	100,000	120,683	95,412	0.08%
SAGAX EURO MTN 1% 05/29	EUR	300,000	360,526	278,352	0.23%
TOTAL SWEDEN			723,445	550,114	0.46%
Szwajcaria					
SANDOZ 3.97% 04/27	EUR	300,000	321,163	324,874	0.27%
UBS GROUP AG CALLABLE NOTES VARIABLE 08/FEB/2030	USD	200,000	199,720	199,645	0.17%
TOTAL SWITZERLAND			520,883	524,519	0.44%
Holandia					
CTP NV 0.625% 09/26	EUR	200,000	234,326	199,616	0.17%
CTP NV 1.25% 06/29	EUR	200,000	239,180	186,182	0.15%
CTP NV 1.5% 09/31	EUR	200,000	233,077	175,736	0.15%
ING GROEP NV VAR 5.75% 12/49	USD	100,000	103,625	96,212	0.08%
PROSUS NV 3.68% 01/30	USD	100,000	100,000	88,901	0.07%
TOTAL THE NETHERLANDS			910,208	746,647	0.62%
Wielka Brytania					
BARCLAYS PLC 4.375% 01/26	USD	400,000	456,358	393,439	0.33%
BARCLAYS PLC VAR 2.894% 11/32	USD	300,000	300,000	248,274	0.21%
BARCLAYS PLC VAR 5.875% 12/49	GBP	200,000	273,791	251,588	0.21%
BCP V 4.75% 11/28	EUR	400,000	462,420	400,320	0.33%
GSK 3.125% 03/25	USD	400,000	398,956	392,809	0.33%
HSBC HOLDINGS PLC 4.95% 03/30	USD	200,000	199,750	196,642	0.16%

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

HSBC HOLDINGS PLC VAR 4.7% 12/49	USD	300,000	300,000	256,458	0.21%
HSBC HOLDINGS VAR 2.357% 08/31	USD	300,000	309,030	250,773	0.21%
HSBC HOLDINGS VAR 2.848% 06/31	USD	600,000	636,932	518,848	0.43%
HSBC HOLDINGS VAR 3.973% 05/30	USD	200,000	213,292	187,011	0.15%
IMPERIAL 1.75% 03/33	EUR	400,000	472,484	347,189	0.29%
INEOS QUATTRO 2.5% 01/26	EUR	100,000	121,505	104,091	0.09%
LLOYDS BANKING GROUP VAR 6.75% 12/49	USD	100,000	107,500	99,709	0.08%
LLOYDS BANKING VAR 12/49	USD	200,000	199,742	204,941	0.17%
LLOYDS BANKING VAR 4.716% 08/26	USD	200,000	200,000	197,742	0.16%
NATWEST GROUP VAR 4.892% 05/29	USD	200,000	223,640	195,586	0.16%
SANTANDER UK VAR 3.823% 11/28	USD	600,000	659,500	567,251	0.47%
STANDARD VAR 1.456% 01/27	USD	200,000	200,000	187,388	0.16%
TESCO 0.375% 07/29	EUR	200,000	240,490	183,141	0.15%
THAMES WATER UTILITIES FINANCE PLC CALLABLE MEDIUM	GBP	100,000	112,468	111,464	0.09%
VMED O2 UK 4.5% 07/31	GBP	400,000	556,680	418,354	0.35%
WORKSPACE 2.25% 03/28	GBP	200,000	279,358	216,518	0.18%
TOTAL UNITED KINGDOM			6,923,896	5,929,536	4.92%

Stany Zjednoczone

AAMES MORTGAGE FLT 5.95% 04/36	USD	305,123	287,956	278,571	0.23%
ABFC 2005-WMC1 FLT 6.205% 06/35	USD	95,729	94,234	90,906	0.08%
ABFC 2006-OPT2 FLT 5.61% 10/36	USD	65,630	60,503	59,971	0.05%
ACE SECURITIES FLT 7.345% 05/34	USD	40,814	39,896	42,045	0.03%
AEGIS ASSET FLT 6.175% 10/35	USD	393,923	387,522	365,204	0.30%
AES CORP/THE 2.45% 01/31	USD	600,000	578,286	494,254	0.41%
ALASKA AIRLINES 4.8% 08/27	USD	217,692	234,175	213,755	0.18%
ALTERNATIVE 5.5% 03/36	USD	49,295	31,002	19,668	0.02%
ALTERNATIVE 6.5% 06/36	USD	1,140,672	674,413	519,038	0.43%
ALTERNATIVE FLT 5.79% 09/47	USD	536,073	514,013	472,724	0.39%
ALTERNATIVE FLT 5.85% 10/46	USD	87,158	81,657	77,527	0.06%
AMERICAN AIRLINES 3% 10/28	USD	129,516	128,919	119,328	0.10%
AMERICAN AIRLINES 3.15% 02/32	USD	234,900	233,138	209,927	0.17%
AMERICAN AIRLINES 3.35% 10/29	USD	67,527	62,884	62,302	0.05%
AMERICAN AIRLINES 3.6% 09/27	USD	62,101	59,772	58,968	0.05%
AMERICAN ASSETS TRUST LP 3.375% 02/31	USD	200,000	206,452	163,978	0.14%
AMERICAN HOME MORTGAGE ASSETS FLT 5.981% 10/46	USD	84,234	79,030	68,094	0.06%
AMERICAN TOWER CORP 0.4% 02/27	EUR	300,000	346,406	295,499	0.24%
AMERIQUEST FLT 5.94% 11/35	USD	64,299	63,254	62,522	0.05%
AMERIQUEST FLT 6.34% 01/36	USD	600,000	594,750	569,228	0.47%
AMERIQUEST FLT 6.445% 07/35	USD	100,000	95,375	95,275	0.08%
AMERIQUEST FLT 6.49% 09/34	USD	227,018	226,947	221,471	0.18%
ANHEUSER-BUSC 4.35% 06/40	USD	100,000	99,937	88,198	0.07%
ARES FINANCE 3.25% 06/30	USD	100,000	99,771	89,185	0.07%
ARGENT FLT 7.27% 11/34	USD	717,386	718,283	643,940	0.53%
ASSET BACKED FLT 6.49% 07/35	USD	81,096	79,575	77,317	0.06%
ASSET BACKED FLT 6.565% 02/35	USD	44,329	44,302	46,374	0.04%
ATHENE GLOBAL FUNDING MEDIUM TERM NOTE VARIABLE	EUR	200,000	216,201	214,692	0.18%
AVIATION 4.125% 08/25	USD	100,000	108,384	98,127	0.08%
AVIATION 5.5% 12/24	USD	500,000	568,433	498,755	0.41%
BANK OF AMERICA CORP VAR 2.592% 04/31	USD	200,000	212,460	172,980	0.14%
BANK OF AMERICA CORP VAR 2.651% 03/32	USD	300,000	300,000	253,950	0.21%
BANK OF AMERICA CORP VAR 2.687% 04/32	USD	500,000	506,155	422,755	0.35%
BANK OF AMERICA CORP VAR 3.974% 02/30	USD	100,000	109,161	94,728	0.08%
BEAR STEARNS FLT 5.653% 04/36	USD	54,804	53,708	54,432	0.05%
BEAR STEARNS FLT 5.7% 02/37	USD	500,000	468,438	473,609	0.39%
BEAR STEARNS FLT 6.1% 02/36	USD	350,110	347,484	348,858	0.29%
BEAR STEARNS FLT 6.145% 08/36	USD	86,020	84,820	85,439	0.07%
BEAR STEARNS FLT 6.325% 07/34	USD	191,849	186,600	185,812	0.15%
BEAR STEARNS FLT 6.49% 10/35	USD	42,512	41,502	41,795	0.03%

Informacje dodatkowe stanowią integralną część niniejszych sprawozdań finansowych

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2024

BLUE OWL 3.125% 06/31	USD	300,000	296,190	250,163	0.21%
BROADCOM INC 2.6% 02/33	USD	400,000	398,352	324,324	0.27%
CARLYLE 3.5% 09/29	USD	150,000	149,501	138,710	0.11%
CHARTER 3.9% 06/52	USD	900,000	873,321	564,908	0.47%
CIT MORTGAGE FLT 6.97% 10/37	USD	88,772	89,715	88,881	0.07%
CITIGROUP FLT 5.64% 07/45	USD	586,752	509,007	403,376	0.33%
CITIGROUP FLT 6.07% 12/35	USD	88,189	79,283	82,948	0.07%
CITIGROUP FLT 6.505% 05/35	USD	100,000	98,750	90,265	0.07%
COTY INC/HFC 4.75% 01/29	USD	600,000	600,000	570,703	0.47%
CREDIT-BASED FLT 6.385% 01/34	USD	123,430	120,228	126,765	0.10%
CWABS FLT 4.877% 05/36	USD	38,515	37,552	37,965	0.03%
CWABS FLT 5.610% 06/35	USD	97,720	89,780	86,460	0.07%
CWABS FLT 5.65% 11/47	USD	75,001	63,625	85,291	0.07%
CWABS FLT 5.720% 02/36	USD	434,009	419,090	408,243	0.34%
CWABS FLT 6.595% 11/35	USD	411,288	411,031	402,288	0.33%
CWABS FLT 7.42% 08/35	USD	600,000	599,250	538,134	0.45%
DELTA AIR LINES 7% 05/25	USD	400,000	452,500	403,096	0.33%
DEUTSCHE ALT-A FLT 5.85% 12/36	USD	632,520	320,436	201,702	0.17%
DISH DBS 5.25% 12/26	USD	500,000	500,000	395,334	0.33%
EPR 4.5% 06/27	USD	50,000	53,960	47,849	0.04%
EXPEDIA 6.25% 05/25	USD	176,000	196,722	176,308	0.15%
FAIR ISAAC CORP 4% 06/28	USD	100,000	100,000	93,626	0.08%
FIRST FRANKLIN FLT 6.674% 01/35	USD	174,496	172,752	172,103	0.14%
FORD MOTOR 1.744% 07/24	EUR	100,000	108,485	107,059	0.09%
FORD MOTOR 2.33% 11/25	EUR	100,000	124,993	104,831	0.09%
FORD MOTOR 2.386% 02/26	EUR	100,000	124,993	104,641	0.09%
FORD MOTOR 3.25% 09/25	EUR	300,000	386,313	318,954	0.26%
FORD MOTOR FLT 4.674% 12/24	EUR	100,000	113,701	107,411	0.09%
FREMONT HOME FLT 6.4% 06/35	USD	1,013,000	990,849	891,827	0.74%
GOLDMAN SACHS VAR 1.431% 03/27	USD	500,000	500,000	466,734	0.39%
GSAMP TRUST FLT 3.689% 11/34	USD	67,246	64,977	62,609	0.05%
GSAMP TRUST FLT 5.67% 11/36	USD	201,406	109,263	95,178	0.08%
GSAMP TRUST FLT 6.145% 11/35	USD	205,744	204,073	196,315	0.16%
HILCORP ENERGY I LP / HILCORP FINANCE CO CALLABLE	USD	200,000	195,500	192,487	0.16%
HOME EQUITY FLT 6.415% 11/35	USD	700,000	695,188	668,560	0.55%
HOME EQUITY FLT 6.715% 03/35	USD	579,956	575,606	565,563	0.47%
HSI ASSET FLT 5.8% 04/37	USD	152,733	102,426	79,254	0.07%
HUDSON 3.25% 01/30	USD	150,000	149,577	103,780	0.09%
HYATT HOTELS 1.8% 10/24	USD	100,000	99,994	98,951	0.08%
INDYMAC INDX FLT 5.89% 07/36	USD	237,754	233,275	225,370	0.19%
INDYMAC INDX FLT 5.97% 02/37	USD	291,484	226,629	182,956	0.15%
INDYMAC INDX VAR 3.673% 08/35	USD	349,708	323,818	248,759	0.21%
JPMORGAN CHASE & CO VAR 2.595% 02/26	USD	500,000	500,000	490,130	0.41%
LEHMAN XS TRUST FLT 5.83% 12/36	USD	61,383	59,865	57,891	0.05%
LEHMAN XS TRUST FLT 6.299% 03/37	USD	35,311	34,520	34,477	0.03%
LIVE NATION 6.5% 05/27	USD	100,000	100,000	100,662	0.08%
LONG BEACH FLT 5.77% 09/36	USD	366,123	273,677	229,165	0.19%
LONG BEACH FLT 6.12% 09/34	USD	243,172	235,572	236,160	0.20%
MILEAGE PLUS 6.5% 06/27	USD	120,000	124,050	120,335	0.10%
MORGAN STANLEY FLT 5.61% 10/36	USD	517,436	305,287	226,646	0.19%
MORGAN STANLEY FLT 5.62% 02/37	USD	286,040	170,283	134,888	0.11%
MORGAN STANLEY FLT 5.67% 02/37	USD	156,259	85,357	73,687	0.06%
MORGAN STANLEY FLT 5.83% 03/36	USD	117,925	100,531	95,408	0.08%
MORGAN STANLEY FLT 6.190% 01/35	USD	702,905	671,494	641,596	0.53%
MORGAN STANLEY FLT 6.52% 09/33	USD	87,912	85,605	87,329	0.07%
MORGAN STANLEY VAR 6.354% 08/36	USD	386,205	132,999	69,427	0.06%

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2024

NEW CENTURY FLT 6.4% 11/34	USD	475,526	466,263	467,724	0.39%
NEW CENTURY FLT 6.415% 09/35	USD	656,825	656,825	642,121	0.53%
NISSAN MOTOR 1.85% 09/26	USD	100,000	99,976	91,590	0.08%
NOVASTAR FLT 5.63% 09/37	USD	34,646	33,593	34,239	0.03%
OMEGA 4.75% 01/28	USD	150,000	163,872	145,222	0.12%
ONEOK INC 6.35% 01/31	USD	100,000	99,667	104,794	0.09%
OPTION ONE FLT 5.61% 03/37	USD	462,346	428,248	409,695	0.34%
OPTION ONE FLT 5.69% 04/37	USD	691,624	590,041	475,625	0.39%
OPTION ONE FLT 5.69% 05/37	USD	213,732	159,364	126,440	0.10%
OPTION ONE FLT 6.1% 12/35	USD	515,252	513,320	490,315	0.41%
OPTION ONE FLT 6.25% 02/35	USD	415,147	414,109	387,814	0.32%
ORGANON & 4.125% 04/28	USD	400,000	400,000	371,837	0.31%
OWNIT MORTGAGE FLT 5.75% 09/37	USD	301,558	282,334	258,382	0.21%
PACIFIC GAS 3.25% 06/31	USD	400,000	399,152	344,143	0.29%
PACIFIC GAS 3.3% 08/40	USD	100,000	99,501	71,300	0.06%
PACIFIC GAS 3.75% 08/42	USD	100,000	103,500	72,200	0.06%
PACIFIC GAS 4.55% 07/30	USD	700,000	782,647	663,715	0.55%
PARK 4.875% 05/29	USD	400,000	400,000	375,475	0.31%
PENSKE TRUCK 4.45% 01/26	USD	200,000	229,382	196,551	0.16%
RALI SERIES FLT 5.81% 01/37	USD	79,661	73,419	66,353	0.05%
RALI SERIES VAR 6.175% 09/37	USD	102,252	73,877	68,155	0.06%
RAMP SERIES FLT 6.21% 05/37	USD	96,921	86,038	85,594	0.07%
RENAISSANCE STEP 5.586% 11/36	USD	1,281,274	659,856	417,883	0.35%
SAXON ASSET FLT 2.163% 03/35	USD	99,225	90,853	84,438	0.07%
SAXON ASSET FLT 6.145% 11/37	USD	527,792	518,555	499,642	0.41%
SAXON ASSET FLT 6.445% 12/34	USD	476,088	469,839	420,973	0.35%
SECURITIZED FLT 5.75% 07/36	USD	94,980	82,158	77,337	0.06%
SECURITIZED FLT 6.145% 10/35	USD	368,505	368,045	349,530	0.29%
SOUNDVIEW HOME FLT 5.62% 03/37	USD	68,753	63,941	63,992	0.05%
SOUNDVIEW HOME FLT 5.64% 07/37	USD	347,978	322,098	298,007	0.25%
SOUNDVIEW HOME FLT 5.97% 10/36	USD	68,608	64,663	64,662	0.05%
SOUNDVIEW HOME FLT 6.22% 03/36	USD	530,739	530,739	519,687	0.43%
SOUTHERN 3.7% 04/30	USD	100,000	99,751	92,235	0.08%
SOUTHERN 3.7% 08/25	USD	200,000	213,530	196,011	0.16%
SPECIALTY FLT 5.77% 11/37	USD	555,572	384,734	307,002	0.25%
SPIRIT 4.6% 06/28	USD	200,000	218,084	187,519	0.16%
STANDARD 2.25% 11/26	EUR	150,000	166,501	152,268	0.13%
STRUCTURED FLT 5.625% 09/36	USD	122,310	96,319	74,160	0.06%
STRUCTURED FLT 5.83% 07/46	USD	81,982	68,420	66,903	0.06%
SYNCHRONY 3.95% 12/27	USD	300,000	334,125	280,304	0.23%
SYNCHRONY 4.5% 07/25	USD	150,000	160,986	147,535	0.12%
SYSTEM 2.14% 12/25	USD	100,000	99,967	94,604	0.08%
TBA FNMA SINGLE 4.5%	USD	5,500,000	5,226,503	5,186,972	4.30%
TBA GNMA2 SINGLE 4% 07/52	USD	3,600,000	3,355,313	3,327,047	2.76%
TBA GNMA2 SINGLE FAMILY 30YR 5.0 08/23	USD	1,000,000	978,359	974,086	0.81%
TBA GNMA2 SINGLE FAMILY 30YR 5.5 07/24	USD	2,600,000	2,561,203	2,579,865	2.14%
TBA GNMA2 SINGLE FAMILY 30YR 6.0 07/24	USD	200,000	200,114	200,862	0.17%
TBA GNMA2 SINGLE FAMILY 30YR 6.0 08/24	USD	1,400,000	1,407,383	1,404,830	1.16%
TBA UMBS SINGLE 3.5% 08/52	USD	2,100,000	1,874,168	1,859,156	1.54%
TBA UMBS SINGLE FAMILY 30YR 5.0 08/23	USD	8,200,000	7,974,339	7,924,530	6.56%
TBA UMBS SINGLE FAMILY 30YR 6.0 08/24	USD	1,500,000	1,509,727	1,503,691	1.25%
TBA UMBS SINGLE FAMILY 4%	USD	3,800,000	3,502,531	3,479,227	2.88%

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2024

TD SYNEX 2.375% 08/28	USD	400,000	400,000	356,476	0.30%
TEGNA INC 4.625% 03/28	USD	100,000	100,000	90,480	0.07%
T-MOBILE USA 2.05% 02/28	USD	100,000	99,787	89,844	0.07%
T-MOBILE USA 2.25% 11/31	USD	200,000	197,366	163,524	0.14%
T-MOBILE USA 3.6% 11/60	USD	100,000	99,745	67,653	0.06%
UNITED AIRLINES 4.625% 04/29	USD	300,000	300,000	279,638	0.23%
UNITED AIRLINES 5.875% 10/27	USD	275,479	300,272	276,558	0.23%
US FOODS 4.625% 06/30	USD	300,000	300,000	278,906	0.23%
VICI 4.625% 06/25	USD	200,000	214,500	197,552	0.16%
WABTEC 1.25% 12/27	EUR	300,000	363,362	298,337	0.25%
WAMU FLT 5.7204% 04/37	USD	1,175,619	572,012	439,783	0.36%
WAMU MORTGAGE FLT 4.426% 05/46	USD	19,449	17,407	17,225	0.01%
WAMU MORTGAGE VAR 4.469% 09/36	USD	405,175	403,646	331,068	0.27%
WARNERMEDIA 3.638% 03/25	USD	200,000	200,000	196,937	0.16%
WELLS FARGO & VAR 4.478% 04/31	USD	700,000	845,579	670,414	0.56%
WELLS FARGO FLT 5.93% 04/37	USD	363,135	359,390	351,313	0.29%
WELLS FARGO FLT 6.07% 04/37	USD	1,100,000	909,375	770,536	0.64%
WMG 2.25% 08/31	EUR	400,000	473,540	374,834	0.31%
WPC EUROBOOND 1.35% 04/28	EUR	200,000	220,388	194,614	0.16%
TOTAL UNITED STATES OF AMERICA			70,700,044	65,789,617	54.48%
Obligacje razem			99,075,447	90,269,043	74.76%
Obligacje skarbowe					
Brazylia					
FEDERATIVE REPUBLIC OF BRAZIL BILL ZERO CPN	BRL	1,160,000	1,982,633	1,928,950	1.60%
TOTAL BRAZIL			1,982,633	1,928,950	1.60%
Republika Dominikany					
DOMINICAN REPUBLIC 5.3% 01/41	USD	150,000	150,000	127,640	0.11%
TOTAL DOMINICAN REPUBLIC			150,000	127,640	0.11%
Izrael					
STATE OF ISRAEL 5% 10/26	EUR	500,000	525,567	543,964	0.45%
TOTAL ISRAEL			525,567	543,964	0.45%
Meksyk					
UNITED MEXICAN STATES 3% 12/26	MXN	1,650,000	644,348	678,495	0.56%
UNITED MEXICAN STATES 4% 11/28	MXN	240,000	107,415	99,802	0.08%
UNITED MEXICAN STATES 6.35% 02/35	USD	200,000	199,264	201,596	0.17%
UNITED MEXICAN STATES BOND FIXED 2.75% 27/NOV/2031	MXN	300,000	124,122	112,148	0.09%
UNITED MEXICAN STATES BOND FIXED 4% 24/AUG/2034	MXN	100,000	45,467	39,762	0.03%
TOTAL MEXICO			1,120,616	1,131,803	0.93%
Peru					
REPUBLIC OF PERU BOND FIXED 6.95% 12/AUG/2031 PEN	PEN	800,000	214,566	214,220	0.18%
TOTAL PERU			214,566	214,220	0.18%
Rumunia					
ROMANIA 1.75% 07/30	EUR	400,000	471,744	350,731	0.29%
TOTAL ROMANIA			471,744	350,731	0.29%
Republika Południowej Afryki					
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 10.5% 12/26	ZAR	47,000,000	3,555,901	2,672,771	2.21%
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 4.85% 09/29	USD	400,000	412,680	366,844	0.30%
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA BOND FIXED 8.5%	ZAR	10,200,000	439,812	439,700	0.36%
TOTAL SOUTH AFRICA			4,408,393	3,479,315	2.87%
Turcja					
REPUBLIC OF TURKEY 6.35% 08/24	USD	250,000	261,750	250,265	0.21%
REPUBLIC OF TURKIYE/THE BOND FIXED 7.625%	USD	300,000	294,846	302,622	0.25%
TOTAL TURKEY			556,596	552,887	0.46%

Informacje dodatkowe stanowią integralną część niniejszych sprawozdań finansowych

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2024

Stany Zjednoczone

GOLDEN ST 2.587% 06/29	USD	400,000	400,000	355,345	0.29%
GOLDEN ST 2.746% 06/34	USD	200,000	200,000	167,172	0.14%
TOBACCO 3.401% 06/34	USD	100,000	100,000	82,258	0.07%
UNITED STATES OF AMERICA 0.375% 04/25	USD	300,000	300,469	288,366	0.24%
UNITED STATES OF AMERICA 0.375% 11/25	USD	1,700,000	1,622,197	1,595,045	1.32%
UNITED STATES OF AMERICA 0.653% 07/32	USD	2,600,000	2,518,432	2,512,200	2.08%
UNITED STATES OF AMERICA 1.147% 01/33	USD	2,400,000	2,346,720	2,335,391	1.93%
UNITED STATES OF AMERICA 1.375% 07/33	USD	2,300,000	2,259,223	2,239,204	1.85%
UNITED STATES OF AMERICA 1.5% 10/24	USD	1,100,000	1,076,547	1,085,895	0.90%
UNITED STATES OF AMERICA 1.875% 02/41	USD	5,600,000	4,445,016	3,833,922	3.18%
UNITED STATES OF AMERICA 2% 06/24	USD	4,500,000	4,406,768	4,499,999	3.73%
UNITED STATES OF AMERICA BILL ZERO CPN 30/JUL/2024	USD	400,000	393,190	398,310	0.33%
TOTAL UNITED STATES OF AMERICA			20,068,562	19,393,107	16.06%

Obligacje skarbowe razem

29,498,677 **27,722,617** **22.95%**
128,574,124 **117,991,660** **97.71%**

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 1,161,931 11,569,797 11,579,803 9.60%

Irlandia razem

11,569,797 **11,579,803** **9.60%**

Fundusze inwestycyjne razem

11,569,797 **11,579,803** **9.60%**

Inwestycje ogółem

140,143,921 **129,571,463** **107.31%**

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Klasyfikacja geograficzna inwestycji na dzień 30 czerwca 2024 r.

	% WAN
Stany Zjednoczone	70.54%
Irlandia	11.77%
Wielka Brytania	4.92%
Republika Południowej Afryki	2.87%
Kajmany	1.98%
Francja	1.91%
Japonia	1.72%
Luksemburg	1.68%
Brazylia	1.60%
Niemcy	1.31%
Włochy	1.03%
Meksyk	1.01%
Holandia	0.62%
Bermudy	0.57%
Turcja	0.46%
Szwecja	0.46%
Izrael	0.45%
Szwajcaria	0.44%
Rumunia	0.37%
Australia	0.28%
Belgia	0.27%
Kanada	0.20%
Dania	0.19%
Jersey	0.18%
Peru	0.18%
Hong Kong	0.15%
Republika Dominikany	0.11%
Ponadnarodowe	0.04%
Razem	107.31%

Ekonomiczna klasyfikacja inwestycji na dzień 30 czerwca 2024 r.

	% WAN
Różne	17.21%
Kredyty hipoteczne	15.43%
Listy zastawne UMBS TBA	12.23%
Noty skarbowe	12.05%
Otwarte fundusze inwestycyjne	9.60%
Listy zastawne GNMA II TBA	7.04%
Emisje niepubliczne	5.37%
Dług państwowy	5.29%
Bankowość i finanse	5.08%
Listy zastawne FNMA TBA ARM	4.30%
Obligacje skarbowe	3.18%
Zobowiązania zabezpieczone pożyczką	2.67%
Pozarządowe	2.24%
Bony skarbowe	1.93%
Narzędzia	1.92%
Leasing sprzętu	0.61%
Obligacja dochodowa	0.50%
Przemysłowe	0.49%
Inne	0.17%
Razem	107.31%

SANTANDER FUTURE WEALTH

Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2024 r.

Opis	Waluta	Ilość	Koszt USD	Wartość rynkowa USD	% WAN
Fundusze inwestycyjne					
Francja					
LYXOR NEW ENERGY DR TOTAL FRANCE	EUR	4,333	152,126	122,088	0.16
Francja razem			152,126	122,088	0.16%
Irlandia					
ISHARES DIGITALISATION	USD	541,665	4,541,859	4,862,797	6.27%
ISHARES ELECTRIC	USD	378,753	2,879,728	2,945,562	3.81%
JANUS HENDERSON GLOBAL LIFE SCIENCES FUND/IRELAND	USD	45,537	1,546,467	1,576,474	2.04%
KBI GLOBAL SUSTN INFR-AD	USD	131,279	1,286,925	1,267,758	1.64%
L&G CYBER SECURITY UCITS	USD	95,071	2,122,706	2,282,655	2.95%
NEUBERGER BERMAN	EUR	263,478	3,623,025	4,679,078	6.05%
WELLINGTON FINTECH FUND	EUR	3	43	40	0.00%
Irlandia razem			16,000,753	17,614,364	22.76%
Luksemburg					
ALLIANZ GLOBAL	EUR	890	2,203,792	2,621,540	3.39%
AXA WORLD FUNDS - FRAMLINGTON ROBOTECH OPEN-END	USD	16,501	3,795,073	4,372,596	5.65%
BELLEVUE FUNDS LUX - BELLEVUE DIGITAL HEALTH	USD	3,245	605,479	578,048	0.75%
BNP PARIBAS EASY ECPI CIRCULAR ECONOMY LEADERS	EUR	228,666	4,112,801	4,685,791	6.05%
BNP PARIBAS FUNDS - AQUA	EUR	5,371	1,995,107	2,116,912	2.74%
BNP PARIBAS FUNDS - ENERGY TRANSITION OPEN-END FUND	EUR	232	256,608	124,475	0.16%
BNP PARIBAS FUNDS - SMART FOOD OPEN-END FUND EUR	EUR	5,727	876,041	829,713	1.07%
CANDRIAM EQUITIES L ONCOLOGY IMPACT OPEN-END FUND	USD	719	1,704,921	1,704,946	2.20%
CPR INVEST - GLOBAL	EUR	21	3,840,910	3,803,764	4.92%
DWS INVEST GLOBAL	EUR	6,156	815,536	801,892	1.04%
EDMOND DE ROTHSCHILD	EUR	19,328	2,582,521	2,845,352	3.68%
FRANKLIN TEMPLETON INVESTMENT FUNDS - FRANKLIN	USD	55,154	3,619,190	3,901,581	5.04%
GAM MULTISTOCK - LUXURY	USD	11,148	1,658,314	1,635,133	2.11%
GOLDMAN SACHS SICAV	USD	198,481	5,649,634	6,053,658	7.81%
INVESCO ASIA CONSUMER	USD	47,994	942,277	872,530	1.13%
JPMORGAN FUNDS - THEMATICS	EUR	4,960	444,735	339,654	0.44%
LYXOR MSCI WORLD	USD	5,343	3,626,098	4,642,665	6.00%
NINETY ONE GLOBAL	USD	128,773	2,510,363	2,433,802	3.14%
NINETY ONE GLOBAL STRATEGY FUND	EUR	38,312	3,375,229	3,540,640	4.58%
NORDEA 1 SICAV - GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT	EUR	35,371	1,330,681	1,418,719	1.84%
PICTET - SECURITY	EUR	4,081	1,626,789	1,707,580	2.21%
ROBECO CAPITAL GROWTH FUNDS - ROBECOSAM	EUR	8,619	2,892,663	2,867,686	3.70%
ROBECO CAPITAL GROWTH NEW WORLD FINANCIALS	USD	17,914	3,487,188	3,631,639	4.69%
TEMPLETON GLOBAL CLIMATE	EUR	83,869	925,340	976,174	1.26%
Luksemburg razem			54,877,290	58,506,490	75.60%
Fundusze inwestycyjne ogółem			71,030,169	76,242,942	98.52%
Inwestycje ogółem			71,030,169	76,242,942	98.52%

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER FUTURE WEALTH

Klasyfikacja geograficzna inwestycji na dzień 30 czerwca 2024 r.

	% WAN
Luksemburg	75.60%
Irlandia	22.76%
Francja	0.16%
Razem	98.52%

Ekonomiczna klasyfikacja inwestycji na dzień 30 czerwca 2024 r.

	% WAN
Fundusze inwestycyjne otwarte	73.28%
ETF	25.24%
Total	98.52%

SANTANDER PROSPERITY

Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2024 r.

Opis	Waluta	Ilość	Koszt USD	Wartość rynkowa USD	% WAN
Australia					
IDP EDUCATION LTD COMMON	AUD	50,911	886,825	515,114	0.99%
Australia razem			886,825	515,114	0.99%
Belgia					
ELIA GROUP SA/NV COMMON	EUR	6,461	801,237	605,554	1.16%
Belgia razem			801,237	605,554	1.16%
Brazylia					
SLC AGRICOLA SA COMMON	BRL	193,448	760,755	607,741	1.16%
Brazylia razem			760,755	607,741	1.16%
Chile					
AGUAS ANDINAS SA COMMON	CLP	2,446,277	617,999	666,041	1.28%
BANCO SANTANDER CHILE	CLP	18,490,619	841,504	865,837	1.66%
Chile razem			1,459,503	1,531,878	2.94%
Dania					
NOVO NORDISK A/S COMMON	DKK	6,150	425,558	888,799	1.70%
Dania razem			425,558	888,799	1.70%
Finlandia					
STORA ENSO OYJ COMMON	EUR	71,407	948,078	976,146	1.87%
Finlandia razem			948,078	976,146	1.87%
Francja					
DANONE SA COMMON STOCK	EUR	15,342	874,012	938,554	1.80%
DASSAULT SYSTEMES SE	EUR	19,755	781,426	747,386	1.43%
Francja razem			1,655,438	1,685,940	3.23%
Niemcy					
KION GROUP AG COMMON	EUR	18,422	677,467	771,784	1.48%
LEG IMMOBILIEN SE	EUR	11,442	758,352	935,174	1.79%
MERCK KGAA COMMON STOCK	EUR	5,004	872,009	829,930	1.59%
VONOVIA SE COMMON STOCK	EUR	36,656	886,472	1,043,045	2.00%
Niemcy razem			3,194,300	3,579,933	6.86%
Irlandia					
GLANBIA PLC COMMON STOCK	EUR	41,207	538,648	803,778	1.54%
MEDTRONIC PLC COMMON	USD	8,259	660,900	650,066	1.25%
Irlandia razem			1,199,548	1,453,844	2.79%
Włochy					
AMPLIFON SPA COMMON	EUR	26,808	783,419	955,034	1.83%
Włochy razem			783,419	955,034	1.83%

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Japonia

AZBIL CORP COMMON STOCK JPY	JPY	23,300	615,255	649,057	1.24%
CHUGAI PHARMACEUTICAL CO	JPY	25,700	804,620	913,224	1.75%
DAIICHI SANKYO CO LTD	JPY	26,700	814,035	916,889	1.76%
KIKKOMAN CORP COMMON	JPY	65,500	739,200	758,792	1.45%
KURITA WATER INDUSTRIES	JPY	20,500	809,238	869,013	1.67%
LION CORP COMMON STOCK JPY	JPY	76,200	683,599	594,025	1.14%
NISSIN FOODS HOLDINGS CO	JPY	24,000	727,253	609,026	1.17%
OTSUKA HOLDINGS CO LTD COMMON STOCK JPY	JPY	15,600	621,008	656,546	1.26%
UNICHARM CORP COMMON	JPY	23,700	860,801	761,270	1.46%
Japonia razem			6,675,009	6,727,842	12.90%

Meksyk

AMERICA MOVIL SAB DE CV	MXN	734,547	623,229	625,463	1.20%
GENTERA SAB DE CV COMMON	MXN	695,745	762,011	862,951	1.65%
GRUPO BIMBO SAB DE CV	MXN	177,397	803,918	626,815	1.20%

Meksyk razem 2,189,158 2,115,229 4.05%

Hiszpania

ACCIONA SA COMMON STOCK	EUR	5,224	869,413	617,550	1.18%
Hiszpania razem			1,555,133	617,550	1.18%

Szwecja

ESSITY AB COMMON STOCK	SEK	26,131	626,021	669,671	1.28%
Szwecja razem			626,021	669,671	1.28%

Szwajcaria

GEBERIT AG COMMON STOCK	CHF	1,319	681,042	779,129	1.49%
Szwajcaria razem			681,042	779,129	1.49%

Holandia

QIAGEN NV COMMON STOCK EUR 0.01.	USD	17,671	802,396	730,094	1.40%
Holandia razem			802,396	730,094	1.40%

Wielka Brytania

AIRTEL AFRICA PLC COMMON	GBP	461,739	632,843	701,005	1.34%
ASTRAZENECA PLC COMMON	GBP	7,078	927,936	1,105,528	2.12%
CONVATEC GROUP PLC	GBP	209,824	593,225	622,780	1.19%
PEARSON PLC COMMON STOCK	GBP	81,287	900,941	1,018,096	1.95%
UNILEVER PLC COMMON	GBP	14,769	763,799	811,189	1.55%

Wielka Brytania razem 3,818,744 4,258,598 8.15%

Stany Zjednoczone

AMGEN INC COMMON STOCK	USD	2,701	722,936	843,927	1.62%
BOSTON SCIENTIFIC CORP	USD	14,454	730,488	1,113,103	2.13%
CHEGG INC COMMON STOCK	USD	79,421	755,937	250,970	0.48%
COLGATE-PALMOLIVE CO	USD	12,084	946,772	1,172,631	2.25%
DEXCOM INC COMMON STOCK	USD	8,740	955,387	990,941	1.90%
EDWARDS LIFESCIENCES	USD	10,982	836,105	1,014,407	1.94%
INTERNATIONAL BUSINESS	USD	4,858	728,031	840,191	1.61%
INTUITIVE SURGICAL INC	USD	2,674	688,966	1,189,530	2.29%
LAUREATE EDUCATION INC	USD	53,705	646,402	802,353	1.54%
MERCK & CO INC COMMON	USD	7,601	794,670	941,004	1.80%
NVIDIA CORP COMMON STOCK	USD	20,330	445,579	2,511,569	4.82%

Informacje dodatkowe stanowią integralną część niniejszych sprawozdań finansowych

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

REGENERON	USD	914	695,823	960,641	1.84%
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	USD	2,932	715,610	874,997	1.68%
STRIDE INC COMMON STOCK	USD	20,835	837,681	1,468,869	2.83%
WASTE MANAGEMENT INC	USD	4,292	729,316	915,655	1.76%
Stany Zjednoczone razem			11,229,703	15,890,788	30.49%
Akcje ogółem			39,006,147	44,588,884	85.47%
Zbywalne papiery wartościowe dopuszczone do oficjalnego notowania na giełdzie lub znajdujące się w obrocie na innym rynku regulowanym - ogółem			<u>39,006,147</u>	<u>44,588,884</u>	<u>85.47%</u>
Fundusze inwestycyjne					
Hiszpania					
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA REIT EUR 1	EUR	81,629	877,131	909,853	1.74%
Hiszpania razem			877,131	909,853	1.74%
Wielka Brytania					
SEGRO PLC REIT GBP 10	GBP	90,119	913,978	1,023,224	1.96%
UNITE GROUP PLC/THE REIT	GBP	75,256	878,166	848,570	1.63%
Wielka Brytania razem			1,792,144	1,871,794	3.59%
Stany Zjednoczone					
KIMCO REALTY CORP REIT	USD	33,475	699,927	651,424	1.25%
SUN COMMUNITIES INC REIT	USD	5,092	691,814	612,771	1.17%
VENTAS INC REIT USD 0.25	USD	17,627	799,987	903,560	1.73%
WELLTOWER INC	USD	10,046	773,219	1,047,296	2.01%
Stany Zjednoczone razem			2,964,947	3,215,051	6.16%
Fundusze inwestycyjne razem			5,634,222	5,996,698	11.49%
Inwestycje ogółem			44,640,369	50,585,582	96.96%

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER PROSPERITY

Klasyfikacja geograficzna inwestycji na dzień 30 czerwca 2024 r.

	% WAN
Stany Zjednoczone	36.65%
Japonia	12.90%
Wielka Brytania	11.74%
Niemcy	6.68%
Meksyk	4.05%
Francja	3.23%
Chile	2.94%
Hiszpania	2.92%
Irlandia	2.79%
Finlandia	1.87%
Włochy	1.83%
Dania	1.70%
Szwajcaria	1.49%
Holandia	1.40%
Szwecja	1.28%
Brazylia	1.16%
Belgia	1.16%
Australia	0.99%
Razem	96.96%

Ekonomiczna klasyfikacja inwestycji na dzień 30 czerwca 2024 r.

	% WAN
Zdrowie/osobiste	20.01%
Żywność/gospodarstwo domowe	14.45%
Różne	13.25%
Elektryka i elektronika	10.91%
Wypoczynek/turystyka	7.79%
Komponenty elektroniczne	6.06%
Nieruchomości	3.79%
Narzędzia	3.62%
Maszyny i inżynieria	3.15%
Przetwarzanie danych	3.04%
Telekomunikacja	2.54%
Produkty leśne	1.87%
Materiały chemiczne	1.68%
Bankowość	1.66%
Usługi finansowe	1.65%
Materiały budowlane	1.49%
Total	96.96%

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER US EQUITY ESG

Zestawienie inwestycji na dzień 30 czerwca 2024 r.

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					
Irlandia					
CRH PLC COMMON STOCK EUR	USD	2,305	140,184	172,829	0.92%
LINDE PLC	USD	559	216,787	245,295	1.31%
Irlandia razem			356,971	418,124	2.23%
Antyle Holenderskie					
SCHLUMBERGER NV COMMON	USD	5,813	287,463	274,257	1.46%
Antyle Holenderskie razem			287,463	274,257	1.46%
Wielka Brytania					
ROYALTY PHARMA PLC	USD	5,546	170,929	146,248	0.78%
Wielka Brytania razem			170,929	146,248	0.78%
Stany Zjednoczone					
NVIDIA CORP COMMON STOCK	USD	10,740	572,422	1,326,820	7.06%
PFIZER INC COMMON STOCK	USD	5,150	175,413	144,097	0.77%
PROCTER & GAMBLE CO/THE	USD	1,934	296,870	318,955	1.70%
ROCKWELL AUTOMATION INC	USD	609	160,748	167,646	0.89%
SALESFORCE.COM INC	USD	741	172,905	190,511	1.02%
SERVICENOW INC COMMON	USD	235	147,835	184,867	0.99%
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	USD	842	237,869	251,278	1.34%
THERMO FISHER SCIENTIFIC	USD	304	163,115	168,112	0.90%
T-MOBILE US INC COMMON	USD	2,030	300,004	357,645	1.91%
TRAVELERS COS INC/THE	USD	1,386	252,133	281,829	1.50%
UBER TECHNOLOGIES INC	USD	2,765	202,819	200,960	1.07%
UNITEDHEALTH GROUP INC	USD	835	402,285	425,232	2.27%
WALMART INC COMMON STOCK	USD	3,639	200,831	246,397	1.31%
WASTE MANAGEMENT INC	USD	938	166,517	200,113	1.07%
WESTINGHOUSE AIR BRAKE	USD	1,275	157,748	201,514	1.07%
DTE ENERGY CO COMMON	USD	1,227	135,247	136,209	0.73%
ELI LILLY & CO COMMON	USD	579	315,161	524,215	2.79%
EXXON MOBIL CORP COMMON	USD	2,316	251,205	266,618	1.42%
GOLDMAN SACHS GROUP	USD	563	189,453	254,656	1.36%
HOME DEPOT INC/THE	USD	853	274,668	293,637	1.56%
INTERCONTINENTAL	USD	1,938	262,917	265,293	1.41%
INTERNATIONAL BUSINESS	USD	2,340	345,217	404,703	2.16%
INTUITIVE SURGICAL INC	USD	481	150,870	213,973	1.14%
JPMORGAN CHASE & CO	USD	2,103	351,695	425,353	2.27%
MCDONALD'S CORP COMMON	USD	887	258,039	226,043	1.20%
MERCK & CO INC COMMON	USD	3,797	442,946	470,069	2.51%
MICROSOFT CORP COMMON	USD	3,699	1,334,635	1,653,267	8.80%
MONDELEZ INTERNATIONAL	USD	2,321	169,066	151,886	0.81%
MORGAN STANLEY COMMON	USD	2,142	184,076	208,181	1.11%
NETFLIX INC COMMON STOCK	USD	539	259,981	363,760	1.94%
NIKE INC COMMON STOCK	USD	1,524	160,607	114,864	0.61%
Stany Zjednoczone razem			13,053,781	16,046,085	85.51%

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Akcje ogółem	<u>13,869,144</u>	16,884,714	<u>89.98%</u>
Zbywalne papiery wartościowe dopuszczone do oficjalnego notowania na giełdzie lub znajdujące się w obrocie na innym rynku regulowanym – ogółem	<u>13,869,144</u>	16,884,714	<u>89.98%</u>

Opis	Waluta	Ilość	Koszt USD	Wartość rynkowa USD	% WAN
Fundusze inwestycyjne					
<i>Irlandia</i>					
AMUNDI S&P 500 ESG UCITS	USD	1,186	148,117	188,326	1.00%
ISHARES CORE S&P 500	USD	324	148,630	187,888	1.00%
Irlandia razem			296,747	376,214	2.00%
Stany Zjednoczone					
AMERICAN TOWER CORP REIT	USD	673	129,967	130,818	0.70%
Stany Zjednoczone razem			129,967	130,818	0.70%
Fundusze inwestycyjne ogółem			<u>426,714</u>	507,032	<u>2.70%</u>
Inwestycje ogółem			<u>14,295,858</u>	<u>17,391,746</u>	<u>92.68%</u>

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Klasyfikacja geograficzna inwestycji na dzień 30 czerwca 2024 r.

	% WAN
Stany Zjednoczone	86.21%
Irlandia	4.23%
Antyle Holenderskie	1.46%
Wielka Brytania	0.78%
Razem	92.68%

Ekonomiczna klasyfikacja inwestycji na dzień 30 czerwca 2024 r.

	% WAN
Przetwarzanie danych	14.88%
Zdrowie/osobiste	10.59%
Komponenty elektryczne	9.39%
Elektryka i elektronika	8.93%
Różne	8.49%
Handel	6.48%
Żywność/gospodarstwo domowe	5.78%
Usługi finansowe	5.28%
Źródła energii	3.45%
Chemikalia	2.96%
Maszyny i inżynieria	2.79%
Bankowość	2.27%
ETF-y	2.00%
Telekomunikacja	1.91%
Wypoczynek/turystyka	1.69%
Ubezpieczenia	1.50%
Transport(morski)	1.07%
Budownictwo (mieszkalne)	0.96%
Materiały budowlane	0.92%
Narzędzia	0.73%
Tekstylnia/odzież	0.61%
Razem	92.68%

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Informacje dodatkowe do sprawozdania

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.

16 stycznia 2024 roku Rada Dyrektorów SICAV podjęła decyzję o uruchomieniu Subfunduszu SANTANDER TARGET MATURITY EURO II z datą wejścia w życie 26 lutego 2024 roku.

22 stycznia 2024 roku Rada Dyrektorów SICAV podjęła decyzję o uruchomieniu Subfunduszu SANTANDER US EQUITY HEDGED z datą wejścia w życie 22 stycznia 2024.

2 kwietnia 2024 roku Rada Dyrektorów SICAV podjęła decyzję o zmianie nazwy Subfunduszu SANTANDER COVERED BOND na SANTANDER GO GLOBAL ENVIRONMENTAL SOLUTIONS, zmianie w fundusz denominowany w dolarze oraz wyznaczyła BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT UK LIMITED jako podmiot zarządzający z datą wejścia w życie 21 maja 2024 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).
-

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

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

- Tytuły Uczestnictwa Klasy A mogą być nabywane wyłącznie przez inwestorów składających zlecenie nabycia o minimalnej wartości 500 EUR, 500 USD lub 1 000 GBP, zgodnie z walutą referencyjną Subfunduszu.
 - Tytuły Uczestnictwa Klasy AD mogą być nabywane wyłącznie przez inwestorów składających zlecenie nabycia o minimalnej wartości 500 EUR, 500 USD lub 1 000 GBP, zgodnie z walutą referencyjną Subfunduszu. W przypadku Tytułów Uczestnictwa Klasy AD zakłada się wypłatę dywidendy posiadaczom Tytułów Uczestnictwa tej klasy.
 - Tytuły Uczestnictwa Klasy B mogą być nabywane wyłącznie przez inwestorów składających zlecenie nabycia o minimalnej wartości 25 000 EUR lub 25 000 USD, zgodnie z walutą referencyjną Subfunduszu.
 - Tytuły Uczestnictwa Klasy BD mogą być nabywane wyłącznie przez inwestorów składających zlecenie nabycia o minimalnej wartości 25 000 EUR lub 25 000 USD zgodnie z walutą referencyjną Subfunduszu. W przypadku Tytułów Uczestnictwa Klasy BD zakłada się wypłatę dywidendy posiadaczom Tytułów Uczestnictwa tej klasy.
 - Tytuły Uczestnictwa Klasy C mogą być nabywane wyłącznie przez inwestorów składających zlecenie nabycia o minimalnej wartości 300 000 EUR lub 300 000 USD, zgodnie z walutą referencyjną Subfunduszu.
 - Tytuły Uczestnictwa Klasy CD mogą być nabywane wyłącznie przez inwestorów składających zlecenie nabycia o minimalnej wartości 300 000 EUR lub 300 000 USD, zgodnie z walutą referencyjną Subfunduszu. W przypadku Tytułów Uczestnictwa Klasy CD zakłada się wypłatę dywidendy posiadaczom Tytułów Uczestnictwa tej klasy.
 - Tytuły Uczestnictwa Klasy D mogą być nabywane wyłącznie przez inwestorów składających zlecenie nabycia o minimalnej wartości 25 000 GBP lub 25 000 USD zgodnie z walutą referencyjną Subfunduszu. W przypadku Tytułów Uczestnictwa Klasy D zakłada się wypłatę dywidendy posiadaczom Tytułów Uczestnictwa tej klasy.
 - Tytuły uczestnictwa Klasy F mogą być nabywane wyłącznie przez Inwestorów Instytucjonalnych w rozumieniu art. 174 znowelizowanej Ustawy z 2010 roku, a zapisy będą możliwe przez ograniczony czas określony przez Radę Dyrektorów. Klasa ta jest uruchamiana z zamiarem z zamiarem osiągnięcia optymalnej wielkości w celu zapewnienia efektywności danego Subfunduszu w interesie jego Akcjonariuszy. Dla tej Klasy nie obowiązuje minimalna kwota subskrypcji nie ma zastosowania do tej Klasy, chyba że Rada Dyrektorów postanowi inaczej.
 - Tytuły uczestnictwa Klasy FD mogą być nabywane wyłącznie przez inwestorów instytucjonalnych w rozumieniu art. 174 Ustawy z 2010 r. i zgodnie z definicją zawartą w rozdziale „Profil ryzyka i profil inwestora” (zwanych dalej „Inwestorami Instytucjonalnymi”).w sekcji „Profil ryzyka i profil inwestora” (zwani dalej „Inwestorami Instytucjonalnymi”), a zapisy będą możliwe w ograniczonych okresach możliwe przez ograniczony czas określony przez Radę Dyrektorów. Klasa ta jest uruchamiana z zamiarem osiągnięcia optymalnego optymalnej wielkości, aby dany Subfundusz był efektywny w interesie jego Akcjonariuszy. Nie ma zastosowania minimalna kwota subskrypcji do tej Klasy, chyba że Rada Dyrektorów postanowi inaczej. Akcje Klasy FD mają na celu wypłatę dywidendy akcjonariuszom posiadającym taką Klasę
 - 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, żeby w odniesieniu do tej Klasy uznać SICAV jako fundusz raportujący zagranicę („brytyjski status raportowania”).
 - Tytuły Uczestnictwa Klasy L mogą być nabywane wyłącznie przez inwestorów instytucjonalnych w rozumieniu art. 174 Ustawy z 2010 r., zdefiniowanych w sekcji „Profil ryzyka i profil inwestora” (zwani dalej „Inwestorami Instytucjonalnymi”) subskrybujący minimalną kwotę 20.000.000 USD lub 20.000.000 EUR w walucie referencyjnej lub walucie Subfunduszu.20.000.000 USD lub 20.000.000 EUR, zgodnie z walutą referencyjną Subfunduszu lub walutą odpowiedniej Klasy, lub minimalną kwotę wyraźnie Klasy lub minimalną kwotę wyraźnie ujawnioną w odpowiednim Załączniku.
 - Tytuły Uczestnictwa Klasy LD mogą być nabywane wyłącznie przez Inwestorów Instytucjonalnych dokonujących subskrypcji na minimalną kwotę 20 000 000 USD lub EUR. 20.000.000 EUR, zgodnie z walutą referencyjną Subfunduszu lub walutą odpowiedniej Klasy lub minimalną kwotą określoną w odpowiednim Załączniku. Akcje Klasy LD mają na celu wypłatę dywidendy akcjonariuszom posiadającym taką Klasę Akcji.
-

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

- 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, żeby 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 SD są zarezerwowane dla dostawców niezależnych usług doradczych lub uznaniowych usług zarządzania inwestycjami, lub 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 instrumentów finansowych („MiFID II”); oraz (ii) mają odrębne ustalenia dotyczące opłat ze swoimi klientami w odniesieniu do tych świadczonych usług i działalności; oraz i działalności; oraz (iii) nie otrzymują żadnych innych opłat, rabatów ani płatności płatnych z aktywów danego Subfunduszu w związku z tymi usługami i działalnością. tych usług i działań. Akcje SD mają na celu wypłatę dywidendy Akcjonariuszom posiadającym taką Klasę Akcji.
- Tytuły Uczestnictwa Klasy SK są zarezerwowane dla dostawców niezależnych usług doradczych lub uznaniowych usług zarządzania inwestycjami, lub 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 instrumentów finansowych („MiFID II”); oraz (ii) mają odrębne ustalenia dotyczące opłat ze swoimi klientami w odniesieniu do tych świadczonych usług i działalności; oraz i działalności; oraz (iii) nie otrzymują żadnych innych opłat, rabatów ani płatności płatnych z aktywów danego Subfunduszu w związku z tymi usługami i działalnością. tych usług i działań. Rada Dyrektorów zamierza uzyskać zaświadczenie od brytyjskiego urzędu skarbowego HM Revenue & Customs Urząd Celny Wielkiej Brytanii, aby SICAV został uznany za raportujący fundusz offshore („status raportowania w Wielkiej Brytanii”) dla tej Klasy.
- 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 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.

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Na dzień 30 czerwca 2024 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 US EQUITY ESG (denominowany w USD)
 - *Klasa A
 - *Klasa AE (denominowana w EUR)
 - *Klasa AEH (denominowana w EUR)
 - *Klasa M
 - *Klasa S

 - 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 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
-

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

*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 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)

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

- *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 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 (denominowana w EUR)
- *Klasa APH (denominowana w GBP)
- *Klasa M
- *Klasa RKP (denominowana w GBP)
- *Klasa V
- *Klasa X
- *Class XE (denominowana w EUR)

SANTANDER GO GLOBAL HIGH YIELD BOND (denominowany w USD)

- *Klasa AE (denominowana w EUR)
 - *Klasa I
 - *Klasa IEH (denominowana w EUR)
-

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

*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 M

*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 M

*Klasa S

SANTANDER TARGET MATURITY 2025 EURO (denominowany w EUR)

*Klasa AD

SANTANDER GLOBAL VOLATILITY (denominowany w EUR)

*Klasa AD

SANTANDER TARGET MATURITY EURO II (denominowany w EUR)

*Klasa AD

SANTANDER US EQUITY HEDGED (denominowany in USD) (utworzony 22 stycznia 2024r.)

*Klasa A

*Klasa X

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

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

Nota 2 – Dystrybucja dywidendy

Rada Dyrektorów SICAV postanowiła w dniu 17 czerwca 2024 roku o wypłaceniu w dniu 28 czerwca 2024 roku zaliczki na poczet dywidendy. Data prawa do dywidendy to 18 czerwca 2024 roku

- SANTANDER AM LATIN AMERICAN FIXED INCOME

*Klasa D: 1.265615 USD

- SANTANDER LATIN AMERICAN CORPORATE BOND

*Klasa AD: 2.435034 USD

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

- SANTANDER CORPORATE COUPON

*Klasa AD: 1.815905 USD

*Klasa CD: 1.895790 USD

*Klasa CDE: 2.186350 EUR

*Klasa ID: 1.907280 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 2024 roku są równe łącznej sumie odpowiednich pozycji sprawozdań finansowych każdego z Subfunduszy, przeliczonych na EUR według kursu wymiany obowiązującego na dzień 30 czerwca 2024 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 2024 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 2024 roku:

1 EUR = 0.847836 GBP

1 EUR = 1.071750 USD

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

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 wymienialna.

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 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

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

określonym przez obie strony w momencie zawarcia umowy. Umowa z przyrzeczeniem odkupu jest podobna w swoich skutkach do pożyczki udzielonej kontrahentowi przez SICAV, przy czym pożyczka taka jest zabezpieczona zbywalnymi papierami wartościowymi. Spółka SICAV rozlicza umowę odkupu tak, jakby była to pożyczka i wykazuje ją w zestawieniu aktywów netto w pozycji "Należności z tytułu umów z przyrzeczeniem odkupu"/ "Zobowiązania z tytułu umów z przyrzeczeniem odkupu". Umowa z przyrzeczeniem odkupu jest z reguły krótkoterminowa i nie podlega przeniesieniu. SICAV wycenia ten rodzaj umowy według kosztu, który w połączeniu z narosłymi odsetkami stanowi przybliżoną wartość, za jaką papiery wartościowe zostaną odkupione przez kontrahenta.

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 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
 - SANTANDER TARGET MATURITY 2026 DOLLAR
 - SANTANDER GO ASIAN EQUITY (utworzony 27 czerwca 2023 r.).
 - SANTANDER US EQUITY ESG,
 - SANTANDER TARGET MATURITY 2025 EURO,
 - SANTANDER GLOBAL VOLATILITY,
 - SANTANDER TARGET MATURITY EURO II,
 - SANTANDER US EQUITY HEDGED
-

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

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

Tytuły uczestnictwa SICAV są umarzane 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 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 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,
- SANTANDER TARGET MATURITY 2026 DOLLAR,
- SANTANDER GO ASIAN EQUITY,
- SANTANDER US EQUITY ESG,
- SANTANDER TARGET MATURITY 2025 EURO,
- SANTANDER GLOBAL VOLATILITY

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
- 0.40% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy B i 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 i Klasy AD
 - 1.20% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy AE i Klasy AEH
 - 0.60% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy I, Klasy ID i Klasy RKP
-

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

- 0.02% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy ME (wygaszony w dniu 24 października 2023 r.)
- 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 i Klasy RHP
- 0.45% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy M, Klasy ME i Klasy V
- 0.53% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy SE

SANTANDER EUROPEAN DIVIDEND

- 2.00% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy A i Klasy AU
- 1.75% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy AD
- 1.50% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy B i 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 i 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 i Klasy AD
- 0.75% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy B i 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
- 1.55% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy AE
- 1.50% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy B
- 0.25% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy F
- 0.70% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy I, Klasy IE i Klasy RKP
- 0.02% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy ME

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
-

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

- 0.40% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy ID

SANTANDER SELECT DEFENSIVE

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

SANTANDER SELECT MODERATE

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

SANTANDER SELECT DYNAMIC

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

SANTANDER MULTI INDEX SUBSTANCE

- 0.95% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy A

SANTANDER MULTI INDEX BALANCE

- 0.95% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy A

SANTANDER 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 i 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% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy A, Klasy AE i Klasy AEH

- 1.20% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy B, Klasy BE i Klasy BEH

- 0.60% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy I, Klasy RKP i Klasy SE

- 0.45% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy IKP, Klasy M i Klasy V

SANTANDER GO GLOBAL ENVIRONMENTAL SOLUTIONS

Do 20 maja 2024:

- 0.35% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy B

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

Od 21 maja 2024:

- 1.25% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy B

- 0.75% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy I

SANTANDER GO DYNAMIC BOND

- 1.60% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy A

- 1.25% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy B i Klasy BEH

- 0.60% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy I, Klasy IEH i Klasy RKP

- 0.42% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy M i Klasy MEH

SANTANDER LATIN AMERICAN INVESTMENT GRADE ESG BOND

- 1.05% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy A

- 0.50% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy I

- 0.05% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy M

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SANTANDER FUTURE WEALTH

- 1.35% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy A, Klasy AE, Klasy AEH i Klasy APH
- 0.03% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy M
- 0.60% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy RKP
- 0.23% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy V, Klasy X i Klasy XE

SANTANDER GO GLOBAL HIGH YIELD BOND

- 1.15% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy A i Klasy AE
- 0.50% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy I i Klasy IEH
- 0.37% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy M

SANTANDER PROSPERITY

- 1.25% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy A, Klasy AE i Klasy AEH
- 0.50% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy I, Klasy IE i Klasy RKP
- 0.42% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy M

SANTANDER TARGET MATURITY 2026 EURO

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

SANTANDER TARGET MATURITY 2026 DOLLAR

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

SANTANDER GO ASIAN EQUITY

- 1.40% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy A, Klasy AE i Klasy AEH
- 0.60% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy I
- 0.57% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy M

SANTANDER US EQUITY ESG

- 1.00% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy A, Klasy AE i Klasy AEH
- 0.03% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy M
- 0.25% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy S

SANTANDER TARGET MATURITY 2025 EURO

- 0.60% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy AD

SANTANDER GLOBAL VOLATILITY

- 0.40% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy X

SANTANDER TARGET MATURITY EURO II (utworzony 26 lutego 2024 r.)

- 0.60% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy A i Klasy AD

SANTANDER US EQUITY HEDGED (utworzony 22 lutego 2024 r.)

- 0.80% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy A
 - 0.15% w skali roku za Tytuły Uczestnictwa Klasy X
-

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Nota 6 - Zobowiązania z tytułu podatków i inne koszty

	SANTANDER US EQUITY ESG	SANTANDER AM EURO EQUITY	SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG
Podatek roczny (Nota 8)	1,808	14,800	54,010
Opłaty za zarządzanie (Nota 5)	2,890	81,736	461,070
Opłaty na rzecz depozytariusza (Nota 7)	359	34,239	6,196
Koszty audytu i prawne	-	37,811	10,312
Koszty administracyjne (Nota 7)	10,876	120,475	123,070
Inne opłaty	5,351	218,109	130,087
	76,873	507,170	784,745

	SANTANDER GO DYNAMIC BOND	SANTANDER FUTURE WEALTH	SANTANDER PROSPERITY
Podatek roczny (Nota 8)	8,202	5,964	3,036
Opłaty za zarządzanie (Nota 5)	72,046	46,993	29,142
Opłaty na rzecz depozytariusza (Nota 7)	75,472	-	-
Koszty audytu i prawne	9,946	3,508	2,621
Koszty administracyjne (Nota 7)	56,106	45,320	6,350
Inne opłaty	64,438	37,203	5,881
	286,210	138,988	47,030

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 jest obniżona do 0,01% wartości aktywów netto. W każdym przypadku, z ogółu aktywów wyłączona jest 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, z 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.

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Nota 10 – Koszty transakcyjne

W okresie zakończonym 30 czerwca 2024 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	116,777	-	116,777
SANTANDER LATIN AMERICAN CORPORATE BOND	USD	77,338	-	77,338
SANTANDER GO NORTH AMERICAN EQUITY	USD	163,032	-	163,032
SANTANDER EUROPEAN DIVIDEND	EUR	33,892	-	33,892
SANTANDER AM LATIN AMERICAN FIXED INCOME	USD	18,136	-	18,136
SANTANDER AM EURO CORPORATE BOND	EUR	31,874	-	31,874
SANTANDER AM EURO EQUITY	EUR	101,419	-	101,419
SANTANDER AM LATIN AMERICAN EQUITY OPPORTUNITIES	USD	5,322	-	5,322
SANTANDER ACTIVE PORTFOLIO 1	USD	18,098	-	18,098
SANTANDER ACTIVE PORTFOLIO 2	USD	17,066	-	17,066
SANTANDER CORPORATE COUPON	USD	22,762	-	22,762
SANTANDER SELECT DEFENSIVE	EUR	39,314	-	39,314
SANTANDER SELECT MODERATE	EUR	35,873	-	35,873
SANTANDER SELECT DYNAMIC	EUR	28,672	-	28,672
SANTANDER MULTI INDEX SUBSTANCE	EUR	24,652	-	24,652
SANTANDER MULTI INDEX BALANCE	EUR	33,285	-	33,285
SANTANDER MULTI INDEX AMBITION	EUR	25,181	-	25,181
SANTANDER SELECT INCOME	EUR	141,187	-	141,187
SANTANDER GO ABSOLUTE RETURN	EUR	77,114	-	77,114
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG	USD	174,793	-	174,793
SANTANDER LATIN AMERICAN INVESTMENT GRADE ESG BOND	USD	14,817	-	14,817
SANTANDER GO DYNAMIC BOND	USD	70,754	-	70,754
SANTANDER LATIN AMERICAN INVESTMENT GRADE ESG BOND	USD	14,817	-	14,817
SANTANDER FUTURE WEALTH	USD	39,133	-	39,133
SANTANDER GO GLOBAL HIGH YIELD BOND	USD	65,092	-	65,092
SANTANDER PROSPERITY	USD	36,360	-	36,360
SANTANDER TARGET MATURITY 2026 EURO	EUR	22,607	-	22,607
SANTANDER TARGET MATURITY 2026 DOLLAR	USD	19,967	-	19,967
SANTANDER GO ASIAN EQUITY	USD	23,421	-	23,421
SANTANDER US EQUITY ESG	USD	9,845	-	9,845
SANTANDER TARGET MATURITY 2025 EURO	EUR	21,657	-	21,657
SANTANDER GLOBAL VOLATILITY	EUR	12,135	-	12,135
SANTANDER TARGET MATURITY EURO II	EUR	17,578	-	17,578
SANTANDER US EQUITY HEDGED	USD	21,792	-	21,792
SANTANDER GO GLOBAL ENVIRONMENTAL SOLUTIONS	USD	49	-	49

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.

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Nota 11 – Terminowe kontrakty walutowe

Na dzień 30 czerwca 2024 roku, Subfundusz SANTANDER US EQUITY ESG miał zawarte następujące terminowe kontrakty walutowe:

	Kupiona ilość		Sprzedana ilość		Data zapadalności	Niezrealizowane USD	Druga strona kontraktu
EUR	1,000	USD	(1,074)	31/07/2024	(1)	JPMorgan Chase & Co.	
EUR	219,210	USD	(234,506)	31/07/2024	762	JPMorgan Chase & Co.	
EUR	2,500	USD	(2,687)	31/07/2024	(3)	JPMorgan Chase & Co.	
EUR	500	USD	(536)	31/07/2024	1	JPMorgan Chase & Co.	
EUR	10,000	USD	(10,696)	31/07/2024	36	JPMorgan Chase & Co.	
				Razem	795		

Na dzień 30 czerwca 2024 roku, Subfundusz SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG miał zawarte następujące terminowe kontrakty walutowe:

	Kupiona ilość		Sprzedana ilość		Data zapadalności	Niezrealizowane EUR	Druga strona kontraktu
BRL	434,044,567	USD	(79,521,558)	31/07/2024	(1,651,490)	JPMorgan Chase & Co.	
EUR	124,917	USD	(133,678)	31/07/2024	390	JPMorgan Chase & Co.	
EUR	460,450	USD	(492,581)	31/07/2024	1,601	JPMorgan Chase & Co.	
EUR	45,096,470	USD	(48,243,356)	31/07/2024	156,838	JPMorgan Chase & Co.	
EUR	216,219	USD	(232,410)	31/07/2024	(351)	JPMorgan Chase & Co.	
EUR	29,317	USD	(31,426)	31/07/2024	39	JPMorgan Chase & Co.	
EUR	161,935	USD	(173,328)	31/07/2024	470	JPMorgan Chase & Co.	
EUR	24,851	USD	(26,621)	31/07/2024	50	JPMorgan Chase & Co.	
USD	12,281	EUR	(11,454)	31/07/2024	(12)	JPMorgan Chase & Co.	
USD	1,209,287	EUR	(1,127,835)	31/07/2024	(1,172)	JPMorgan Chase & Co.	
				Razem	(1,493,637)		

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Na dzień 30 czerwca 2024 roku, Subfundusz SANTANDER GO DYNAMIC BOND miał zawarte następujące terminowe kontrakty walutowe:

	Kupiona ilość		Sprzedana ilość	Data zapadalności	Niezrealizowane EUR	Dруга strona kontraktu
AUD	628,762	USD	(418,923)	02/07/2024	996	Australia & New Zealand Banking
AUD	517,238	USD	(344,638)	02/07/2024	799	BNP Paribas S.A.
BRL	5,184,958	USD	(1,010,713)	02/08/2024	(80,713)	Goldman Sachs Bank USA
BRL	1,600,000	USD	(297,177)	02/07/2024	(9,120)	Goldman Sachs Bank USA
BRL	2,300,000	USD	(427,335)	02/07/2024	(13,252)	Goldman Sachs Bank USA
BRL	1,600,000	USD	(295,192)	02/07/2024	(7,135)	Goldman Sachs Bank USA
BRL	3,000,000	USD	(553,587)	02/07/2024	(13,480)	Goldman Sachs Bank USA
BRL	2,100,000	USD	(386,072)	02/07/2024	(7,997)	Goldman Sachs Bank USA
BRL	200,000	USD	(36,675)	02/07/2024	(668)	JPMorgan Chase & Co.
CHF	1,078,405	USD	(1,201,693)	02/07/2024	(1,598)	JP Morgan Securities Plc
COP	698,446,987	USD	(174,129)	15/08/2024	(6,841)	Toronto Dominion Bank
EUR	80,000	USD	(86,890)	02/07/2024	(1,150)	JP Morgan Securities Plc
EUR	340,000	USD	(365,178)	31/07/2024	(271)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	1,426,842	USD	(1,526,409)	31/07/2024	4,962	JPMorgan Chase & Co.
EUR	29,329,762	USD	(31,376,428)	31/07/2024	102,002	JPMorgan Chase & Co.
EUR	112,066	USD	(120,365)	31/07/2024	(89)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	29,588,710	USD	(31,653,446)	31/07/2024	102,903	JPMorgan Chase & Co.
EUR	15,000	USD	(16,049)	31/07/2024	50	JPMorgan Chase & Co.
EUR	197,355	USD	(212,105)	31/07/2024	(292)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	14,762,000	USD	(15,816,004)	02/07/2024	5,169	Standard Chartered Bank London
EUR	30,000	USD	(32,152)	31/07/2024	45	JPMorgan Chase & Co.
EUR	81,984	USD	(87,693)	31/07/2024	297	JPMorgan Chase & Co.
EUR	300,000	USD	(321,799)	31/07/2024	180	JPMorgan Chase & Co.
GBP	507,000	USD	(646,706)	02/07/2024	(5,808)	Barclays London
GBP	1,053,225	USD	(1,331,812)	02/07/2024	(431)	BNP Paribas S.A.
IDR	1,638,500,000	USD	(100,000)	22/07/2024	148	JPMorgan Chase & Co.
INR	2,650,282	USD	(31,695)	24/09/2024	15	Morgan Stanley & Co. Incorporated
INR	9,233,521	USD	(110,201)	24/09/2024	276	JPMorgan Chase & Co.
INR	41,839,157	USD	(499,902)	24/09/2024	692	Standard Chartered Bank Plc
INR	4,917,291	USD	(58,749)	15/07/2024	227	Morgan Stanley & Co. Incorporated
INR	131,230,970	USD	(1,567,873)	15/07/2024	6,050	Morgan Stanley & Co. Incorporated
INR	5,421,303	USD	(64,766)	15/07/2024	255	Morgan Stanley & Co. Incorporated
INR	4,918,302	USD	(58,745)	15/07/2024	243	BNP Paribas S.A.
INR	3,934,416	USD	(46,996)	15/07/2024	192	JPMorgan Chase & Co.
INR	4,425,643	USD	(52,871)	15/07/2024	208	BNP Paribas S.A.
MXN	2,642	USD	(141)	18/09/2024	2	Barclays London
MXN	6,384,557	USD	(343,814)	15/07/2024	4,647	Goldman Sachs Bank USA
MXN	11,043,000	USD	(803,257)	15/07/2024	(543)	Barclays London
NZD	436,000	USD	(267,962)	02/07/2024	(2,286)	JP Morgan Securities Plc
NZD	326,000	USD	(200,045)	02/07/2024	(1,396)	Bank of America
NZD	253,502	USD	(155,270)	02/08/2024	(799)	Toronto Dominion Bank

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

NZD	174,044	USD	(106,584)	02/08/2024	(531)	Australia & New Zealand Banking
NZD	334,454	USD	(203,821)	02/08/2024	(22)	JP Morgan Securities Plc
PLN	1,406,000	USD	(347,334)	22/07/2024	2,340	JPMorgan Chase & Co.
PLN	85,000	USD	(21,129)	22/07/2024	11	Morgan Stanley & Co. Incorporated
PLN	49,000	USD	(12,048)	22/07/2024	138	Toronto Dominion Bank
PLN	37,000	USD	(9,373)	22/07/2024	(171)	Goldman Sachs Bank USA
PLN	2,676,000	USD	(681,550)	22/07/2024	(16,025)	JPMorgan Chase & Co.
PLN	45,000	USD	(11,461)	22/07/2024	(269)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
PLN	4,802,000	USD	(1,186,633)	22/07/2024	7,631	Morgan Stanley & Co. Incorporated
PLN	30,000	USD	(7,365)	22/07/2024	96	Barclays London
PLN	4,804,099	USD	(1,203,307)	22/07/2024	(8,520)	Barclays London
SGD	1,660,468	USD	(1,224,311)	02/07/2024	901	BNP Paribas S.A.
TRY	1,230,612	USD	(25,397)	12/03/2025	3,537	JPMorgan Chase & Co.
TRY	1,398,717	USD	(29,265)	13/03/2025	3,589	Goldman Sachs Bank USA
TRY	3,055,526	USD	(85,647)	17/07/2024	6,053	Barclays London
TRY	896,815	USD	(24,211)	04/09/2024	1,297	Barclays London
TRY	1,573,804	USD	(43,839)	08/08/2024	2,266	JPMorgan Chase & Co.
TRY	834,241	USD	(21,139)	08/11/2024	1,047	JPMorgan Chase & Co.
TRY	3,555,014	USD	(105,371)	03/07/2024	2,952	JPMorgan Chase & Co.
TRY	1,825,215	USD	(53,683)	11/07/2024	1,454	JPMorgan Chase & Co.
TRY	1,298,244	USD	(38,147)	12/07/2024	1,029	JPMorgan Chase & Co.
TRY	1,779,543	USD	(52,473)	23/07/2024	582	Barclays London
TRY	1,280,228	USD	(37,549)	25/07/2024	535	Barclays London
TRY	4,923,032	USD	(145,600)	26/07/2024	687	Barclays London
TRY	1,871,438	USD	(55,278)	30/07/2024	85	Barclays London
TRY	2,426,502	USD	(71,508)	31/07/2024	197	Barclays London
TRY	1,915,780	USD	(56,027)	07/08/2024	157	JPMorgan Chase & Co.
TRY	1,916,534	USD	(55,534)	09/08/2024	550	Barclays London
TRY	3,979,935	USD	(115,979)	06/08/2024	866	Barclays London
TRY	3,880,510	USD	(111,863)	22/08/2024	91	Barclays London
TRY	7,697,246	USD	(223,037)	14/08/2024	986	Goldman Sachs Bank USA
TRY	2,316,706	USD	(66,095)	29/08/2024	227	Barclays London
TRY	2,602,780	USD	(74,143)	28/08/2024	452	JPMorgan Chase & Co.
TRY	544,302	USD	(15,446)	27/08/2024	171	Barclays London
TRY	2,013,342	USD	(55,861)	17/09/2024	607	Barclays London
TRY	2,360,212	USD	(66,527)	10/09/2024	172	Goldman Sachs Bank USA
USD	684,408	BRL	(3,400,000)	02/07/2024	72,286	JPMorgan Chase & Co.
USD	1,494,014	BRL	(7,400,000)	02/07/2024	161,749	Goldman Sachs Bank USA
USD	2,267,155	PLN	(9,186,866)	22/07/2024	(17,632)	BNP Paribas S.A.
USD	11,015	PLN	(45,000)	22/07/2024	(177)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
USD	632,250	SGD	(850,993)	02/07/2024	4,327	JP Morgan Securities Plc
USD	1,993,040	GBP	(1,560,225)	02/07/2024	20,760	BNP Paribas S.A.
USD	15,764,352	EUR	(14,520,000)	02/07/2024	202,542	Bank of America
USD	63,333	JPY	(9,875,451)	02/07/2024	1,941	UBS AG
USD	222,720	CAD	(304,000)	02/07/2024	555	Goldman Sachs Bank USA
USD	130,503	MXN	(2,361,652)	18/09/2024	2,937	JP Morgan Securities Plc
USD	63,177	EUR	(58,000)	02/07/2024	1,015	JP Morgan Securities Plc
USD	251,133	TWD	(8,124,077)	15/07/2024	771	Morgan Stanley & Co. Incorporated
USD	1,850,000	KRW	(2,546,895,000)	15/07/2024	855	Morgan Stanley & Co. Incorporated
USD	158,245	TWD	(5,118,704)	15/07/2024	500	Goldman Sachs Bank USA
USD	525,422	TWD	(16,997,402)	15/07/2024	1,608	Standard Chartered Bank Plc
USD	227,888	TWD	(7,372,336)	15/07/2024	692	JPMorgan Chase & Co.
USD	687,312	TWD	(22,238,569)	15/07/2024	1,979	BNP Paribas S.A.

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

USD	306,174	BRL	(1,700,000)	02/04/2025	9,541	Goldman Sachs Bank USA
USD	1,869,230	CNH	(13,457,000)	25/10/2024	9,372	Standard Chartered Bank Pic
USD	450,463	BRL	(2,500,000)	02/04/2025	14,238	Goldman Sachs Bank USA
USD	119,022	EUR	(111,000)	02/07/2024	57	MS (FX OPS) London
USD	908,894	ZAR	(16,628,776)	19/07/2024	(597)	Goldman Sachs Bank USA
USD	304,049	BRL	(1,700,000)	02/04/2025	7,416	Goldman Sachs Bank USA
USD	92,671	MXN	(1,712,976)	15/07/2024	(821)	Barclays London
USD	572,417	BRL	(3,200,000)	02/04/2025	14,049	Goldman Sachs Bank USA
USD	102,236	SGD	(138,000)	02/07/2024	410	Barclays London
USD	164,304	EUR	(153,000)	02/07/2024	326	JP Morgan Securities Pic
USD	56,544	MXN	(1,056,000)	18/09/2024	(497)	Goldman Sachs Bank USA
USD	410,212	BRL	(2,300,000)	02/04/2025	8,885	Goldman Sachs Bank USA
USD	35,582	BRL	(200,000)	02/04/2025	684	JPMorgan Chase & Co.
USD	53,806	EUR	(50,065)	31/07/2024	74	JPMorgan Chase & Co.
USD	155,270	NZD	(253,502)	02/07/2024	799	Toronto Dominion Bank
USD	344,932	AUD	(517,238)	02/08/2024	(803)	BNP Paribas S.A.
USD	15,839,257	EUR	(14,762,000)	02/08/2024	(5,787)	Standard Chartered Bank London
USD	106,585	NZD	(174,044)	02/07/2024	531	Australia & New Zealand Banking
USD	9,574	SGD	(13,000)	02/07/2024	(18)	JP Morgan Securities Pic
USD	1,224,311	SGD	(1,658,068)	02/08/2024	(1,002)	BNP Paribas S.A.
USD	1,201,693	CHF	(1,074,420)	02/08/2024	1,415	JP Morgan Securities Pic
USD	9,842	MXN	(180,000)	10/07/2024	10	Barclays London
USD	83,052	PEN	(317,367)	01/08/2024	205	Standard Chartered Bank Pic
USD	1,332,031	GBP	(1,053,225)	02/08/2024	393	BNP Paribas S.A.
USD	606,998	MXN	(11,179,000)	15/07/2024	(3,138)	JP Morgan Securities Pic
USD	203,816	NZD	(334,454)	02/07/2024	17	JP Morgan Securities Pic
USD	41,717	GBP	(33,000)	02/08/2024	(6)	JP Morgan Securities Pic
USD	136,804	PEN	(524,000)	01/08/2024	16	Standard Chartered Bank Pic
USD	1,398,147	CAD	(1,913,646)	02/08/2024	(1,385)	Standard Chartered Bank London
USD	61,376	JPY	(9,811,413)	02/08/2024	85	Standard Chartered Bank London
ZAR	22,435,999	USD	(1,217,510)	19/07/2024	9,601	Standard Chartered Bank London
ZAR	2,471,457	USD	(135,910)	19/07/2024	(737)	BNP Paribas S.A.

Razem 585,145

Na dzień 30 czerwca 2024 roku, Subfundusz SANTANDER FUTURE WEALTH miał zawarte następujące terminowe kontrakty walutowe:

	Kupiona ilość		Sprzedana ilość	Data zapadalności	Niezrealizowane EUR	Druga strona kontraktu
BRL	28,747,041	USD	(5,266,762)	31/07/2024	(109,379)	JPMorgan Chase & Co.
BRL	54,650	USD	(10,000)	31/07/2024	(196)	JPMorgan Chase & Co.
EUR	269,139	USD	(287,919)	31/07/2024	936	JPMorgan Chase & Co.
GBP	108,101	USD	(136,593)	31/07/2024	82	JPMorgan Chase & Co.
GBP	25,352	USD	(32,007)	31/07/2024	45	JPMorgan Chase & Co.
USD	11,000	BRL	(61,009)	31/07/2024	55	JPMorgan Chase & Co.
				Razem	(108,457)	

Na dzień 30 czerwca 2024 roku, Subfundusz SANTANDER PROSPERITY miał zawarte następujące terminowe kontrakty walutowe:

	Kupiona ilość		Sprzedana ilość	Data zapadalności	Niezrealizowane USD	Druga strona kontraktu
EUR	1,176,336	USD	(1,258,422)	31/07/2023	4,091	JPMorgan Chase & Co.
				Razem	4,091	

Nota 12 - Kontrakty futures

Na dzień 30 czerwca 2024 roku, Subfundusz SANTANDER GO DYNAMIC BOND miał zawarte następujące kontrakty futures:

Opis	Data zapadalności	Waluta	Ilość kontraktów kupiona/ (sprzedana)	Wartość rynkowa USD	Niezrealizowa ne USD	Druga strona kontraktu
EURO-SCHATZ	06/09/2024	EUR	(44)	(4,650,800)	(21,714)	Société Générale Paris
EURO-BUND	06/09/2024	EUR	(25)	(3,290,500)	(45,774)	Société Générale Paris
US 5YR NOTE (CBT) BOND	30/09/2024	USD	65	6,927,578	29,453	Morgan Stanley & Co. Incorporated
US 2Y NOTE (CBT) BOND	30/09/2024	USD	69	14,091,094	21,832	Morgan Stanley & Co. Incorporated
EURO-BOBL	06/09/2024	EUR	(56)	(6,520,640)	(69,332)	Société Générale Paris
US 10YR NOTE (CBT) BOND	19/09/2024	USD	(28)	(3,079,563)	(17,922)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
CANADIAN 10Y BOND FUTURE	18/09/2024	CAD	12	1,440,840	7,505	Goldman Sachs AG
LONG GILT FUTURE BOND	26/09/2024	GBP	(3)	(292,710)	(1,214)	BOFA Securities Europe S.A.
US LONG CBT BOND	19/09/2024	USD	(1)	(118,313)	188	Morgan Stanley & Co. Incorporated
US 10YR ULTRA FUTURE	19/09/2024	USD	(157)	(17,824,406)	(172,945)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
US ULTRA CBT BOND	19/09/2024	USD	(46)	(5,765,813)	(65,406)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
				Razem	(335,329)	

Na dzień 30 czerwca 2024 roku, Subfundusz SANTANDER FUTURE WEALTH miał zawarte następujące kontrakty futures:

Opis	Data zapadalności	Waluta	Ilość kontraktów kupiona/ (sprzedana)	Wartość rynkowa USD	Niezrealizowa ne USD	Druga strona kontraktu
S&P500 EMINI EQUITY INDEX	20/09/2024	USD	8	2,208,600	7,540	UBS Europe SE
				Razem	7,540	

Nota 13 - Kontrakty na opcje

Na dzień 30 czerwca 2024 roku, Subfundusz SANTANDER GO DYNAMIC BOND miał zawarte następujące kontrakty na opcje:

Opis	Waluta	Kupno/ sprzedaż	Data zapadalności	Cenność kupiona wykonania	Wartość rynkowa USD	Druga strona kontraktu
SWAPTION - SOP	EUR	PUT	21/11/2024	2.82	1,800,000	1,285 JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	EUR	PUT	11/12/2024	2.93	900,000	1,134 JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	EUR	PUT	15/11/2024	2.75	1,800,000	967 JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	EUR	PUT	13/11/2024	2.75	3,600,000	1,822 JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	EUR	PUT	25/11/2024	2.92	1,800,000	1,766 JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	EUR	PUT	14/11/2024	2.73	1,800,000	871 JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	EUR	PUT	13/12/2024	2.90	900,000	1,083 JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	EUR	PUT	29/11/2024	2.93	1,800,000	1,965 JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	EUR	PUT	18/11/2024	2.77	900,000	510 JP Morgan (Germany)
					Razem	16,188

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

SWAPTION - SOP	EUR	PUT	20/11/2024	2.80	1,800,000	1,189	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	EUR	PUT	22/11/2024	2.85	900,000	712	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	EUR	PUT	09/12/2024	2.90	1,800,000	2,019	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	EUR	PUT	17/12/2024	2.80	900,000	865	JP Morgan (Germany)

Opis	Waluta	Kupno/ sprzedaż	Data zapadalności	Cena wykonania	Ilość sprzedana	Zaangażowanie	Wartość rynkowa USD	Druga strona kontraktu
SWAPTION - SOP	USD	CALL	05/07/2024	3.85	(300,000)	4,155	(112)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	USD	CALL	28/06/2024	4.06	(200,000)	-	(2,239)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	USD	CALL	28/06/2024	3.99	(200,000)	-	(1,157)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	USD	CALL	08/07/2024	3.88	(300,000)	32,979	(1,081)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	USD	CALL	22/07/2024	3.77	(200,000)	25,072	(718)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	USD	CALL	22/07/2024	3.68	(100,000)	7,586	(215)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	USD	CALL	24/07/2024	3.54	(300,000)	11,724	(313)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	USD	CALL	24/07/2024	3.65	(600,000)	44,070	(1,209)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	USD	CALL	18/07/2024	3.63	(300,000)	13,938	(393)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	USD	CALL	23/07/2024	3.64	(100,000)	6,481	(179)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	USD	CALL	29/07/2024	3.69	(100,000)	11,076	(304)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	USD	CALL	29/07/2024	3.63	(100,000)	8,154	(218)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	USD	PUT	05/07/2024	4.25	(300,000)	75,210	(76)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	USD	PUT	08/07/2024	4.23	(300,000)	34,140	(45)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	USD	PUT	22/07/2024	4.27	(200,000)	36,856	(167)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	USD	PUT	22/07/2024	4.03	(100,000)	53,987	(412)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	USD	PUT	24/07/2024	4.00	(300,000)	174,939	(1,583)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	USD	PUT	24/07/2024	4.00	(600,000)	351,750	(3,202)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	USD	PUT	18/07/2024	3.98	(300,000)	190,632	(1,566)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	USD	PUT	23/07/2024	3.99	(100,000)	60,273	(540)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	USD	PUT	29/07/2024	4.04	(100,000)	51,419	(465)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	USD	PUT	29/07/2024	4.09	(100,000)	43,978	(352)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	EUR	CALL	21/11/2024	2.36	(200,000)	34,336	(1,232)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	EUR	CALL	15/07/2024	2.55	(100,000)	2,658	(68)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	EUR	CALL	11/12/2024	2.47	(100,000)	25,475	(972)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	EUR	CALL	15/11/2024	2.31	(200,000)	28,749	(1,014)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	EUR	CALL	11/07/2024	2.82	(300,000)	66,161	(706)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	EUR	CALL	13/11/2024	2.31	(400,000)	56,216	(1,967)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	EUR	CALL	25/11/2024	2.40	(200,000)	39,419	(1,430)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	EUR	CALL	14/11/2024	2.30	(200,000)	27,602	(970)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	EUR	CALL	13/12/2024	2.43	(100,000)	23,162	(884)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	EUR	CALL	29/11/2024	2.47	(200,000)	48,327	(1,793)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	EUR	CALL	18/11/2024	2.31	(100,000)	14,523	(514)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	EUR	CALL	20/11/2024	2.35	(200,000)	33,309	(1,190)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	EUR	CALL	22/11/2024	2.36	(100,000)	17,469	(629)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	EUR	CALL	09/12/2024	2.40	(200,000)	41,837	(1,570)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	EUR	CALL	17/12/2024	2.35	(100,000)	19,491	(742)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	EUR	CALL	18/07/2024	2.55	(100,000)	3,914	(93)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	EUR	CALL	25/07/2024	2.57	(100,000)	6,975	(159)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	EUR	PUT	15/07/2024	2.88	(100,000)	56,018	(402)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	EUR	PUT	11/07/2024	3.12	(300,000)	28,989	(81)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	EUR	PUT	18/07/2024	2.89	(100,000)	52,606	(424)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	EUR	PUT	25/07/2024	2.90	(100,000)	49,606	(467)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	GBP	CALL	05/07/2024	3.70	(100,000)	1,897	(62)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	GBP	CALL	03/07/2024	3.80	(100,000)	2,700	(124)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	GBP	PUT	05/07/2024	4.07	(100,000)	21,785	(57)	JP Morgan (Germany)
SWAPTION - SOP	GBP	PUT	03/07/2024	4.15	(100,000)	2,234	(4)	JP Morgan (Germany)
						Razem	(34,100)	

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Na dzień 30 czerwca 2024 roku, Subfundusz SANTANDER FUTURE WEALTH miał zawarte następujące kontrakty na opcje:

Opis	Waluta	Kupno/ sprzedaż	Data zapadalności	Cena wykonania	Ilość kupiona	Wartość rynkowa a USD	Druga strona kontraktu
E-MINI NASDAQ 100	USD	PUT	20/09/2024	19,250.00	16	117,600	Banco Santander S.A.
					Razem	117,600	

Opis	Waluta	Kupno/ sprzedaż	Data zapadalności	Cena wykonania	Ilość sprzedana	Zaangażowa nie	Wartość rynkowa USD	Druga strona kontraktu
E-MINI NASDAQ 100	USD	PUT	20/09/2024	17,800.00	(16)	666,432	(38,320)	Banco Santander S.A.
					Razem		(38,320)	

Nota 14 – Kontrakty swap ryzyka kredytowego

Na dzień 30 czerwca 2024 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	311	311	BNP Paribas S.A.
200,000	USD	CDS	SELL	1.000%	12/24	687	687	Barclays Bank
200,000	USD	CDS	SELL	1.000%	12/25	1,021	1,021	Goldman Sachs Bank USA
300,000	USD	CDS	SELL	1.000%	12/25	1,283	1,283	BNP Paribas S.A.
100,000	USVS	CDS	SELL	1.000%	06/26	1,163	1,163	Morgan Stanley & Co. Incorporated
300,000	USVS	CDS	SELL	1.000%	06/26	3,490	3,490	Morgan Stanley & Co. Incorporated
200,000	USVS	CDS	SELL	5.000%	12/25	13,353	13,353	Morgan Stanley & Co. Incorporated
300,000	USVS	CDS	SELL	5.000%	12/25	20,029	20,029	Morgan Stanley & Co. Incorporated
600,000	USVS	CDS	SELL	5.000%	12/25	41,386	41,386	Morgan Stanley & Co. Incorporated
100,000	USVS	CDS	SELL	5.000%	12/25	6,676	6,676	Morgan Stanley & Co. Incorporated
200,000	EUVS	CDS	SELL	1.000%	06/28	4,515	4,515	Morgan Stanley & Co. Incorporated
100,000	EUVS	CDS	SELL	1.000%	06/28	2,258	2,258	Morgan Stanley & Co. Incorporated
300,000	EUVS	CDS	SELL	1.000%	06/28	6,773	6,773	Morgan Stanley & Co. Incorporated
200,000	EUR	CDS	SELL	5.000%	12/26	23,454	23,454	JP Morgan Chase Bank
100,000	EUR	CDS	SELL	5.000%	12/26	11,727	11,727	JP Morgan Chase Bank
100,000	USVS	CDS	SELL	1.000%	06/28	1,598	1,598	Morgan Stanley & Co. Incorporated
					Razem	139,724	139,726	

Ilość	Waluta	Jednostka ref.	Kupno/ Sprzedaż	Odsetki (Zapłacone) Otrzymane	Data zapadalności	Wartość rynkowa USD	Niezrealizowany zysk/(strata) USD	Druga strona kontraktu
1,188,000	USVS	CDI	BUY	5.000%	12/28	(76,418)	(76,418)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
495,000	USVS	CDI	BUY	5.000%	12/28	(31,841)	(31,841)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
					Razem	(108,259)	(108,259)	

Nota 15 – Kontrakty swap stóp procentowych

Na dzień 31 czerwca 2024 roku, Subfundusz SANTANDER GO DYNAMIC BOND miał zawarte następujące kontrakty swap stóp procentowych:

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Ilość	Waluta	Data zapadalności	Opis	Stopa procentowa otrzymana	Stopa procentowa zapłacona	Niezrealizowany zysk/(strata) EUR	Druga strona kontraktu
200,000	EUVS	06/29	IRS	2.950%	EURIBOR 6M	665	Morgan Stanley & Co. Incorporated
710,000	EUVS	09/54	IRS	EURIBOR 6M	2.500%	607	Morgan Stanley & Co. Incorporated
690,000	EUVS	09/54	IRS	EURIBOR 6M	2.500%	589	Morgan Stanley & Co. Incorporated
100,000	EUVS	06/29	IRS	EURIBOR 6M	2.818%	236	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,500,000	USVS	12/52	OIS	SOFR 1D	1.750%	541,631	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,380,000	USVS	03/31	OIS	SOFR 1D	0.750%	298,585	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,300,000	USVS	07/53	OIS	SOFR 1D	1.999%	435,304	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,000,000	USVS	09/53	OIS	SOFR 1D	1.842%	356,578	Morgan Stanley & Co. Incorporated
600,000	USVS	10/33	OIS	4.170%	SOFR 1D	5,316	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,600,000	USVS	10/53	OIS	SOFR 1D	2.060%	551,646	Morgan Stanley & Co. Incorporated
200,000	USVS	12/33	OIS	SOFR 1D	3.950%	1,255	Morgan Stanley & Co. Incorporated
100,000	USVS	12/33	OIS	SOFR 1D	3.854%	1,385	Morgan Stanley & Co. Incorporated
100,000	USVS	01/34	OIS	SOFR 1D	3.810%	1,734	Morgan Stanley & Co. Incorporated
100,000	USVS	01/34	OIS	SOFR 1D	3.750%	2,235	Morgan Stanley & Co. Incorporated
200,000	USVS	01/34	OIS	SOFR 1D	3.670%	5,750	Morgan Stanley & Co. Incorporated
200,000	USVS	01/34	OIS	SOFR 1D	3.648%	6,126	Morgan Stanley & Co. Incorporated
200,000	USVS	01/34	OIS	SOFR 1D	3.594%	7,007	Morgan Stanley & Co. Incorporated
2,700,000	USVS	10/30	OIS	SOFR 1D	3.589%	75,632	Morgan Stanley & Co. Incorporated
900,000	USVS	10/30	OIS	SOFR 1D	3.595%	24,877	Morgan Stanley & Co. Incorporated
700,000	USVS	10/30	OIS	SOFR 1D	3.601%	19,111	Morgan Stanley & Co. Incorporated
100,000	USVS	10/30	OIS	SOFR 1D	3.545%	3,056	Morgan Stanley & Co. Incorporated
400,000	USVS	01/34	OIS	SOFR 1D	3.600%	13,664	Morgan Stanley & Co. Incorporated
200,000	USVS	10/30	OIS	SOFR 1D	3.623%	5,197	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,200,000	USVS	10/30	OIS	SOFR 1D	3.582%	34,121	Morgan Stanley & Co. Incorporated
500,000	USVS	10/30	OIS	SOFR 1D	3.689%	11,064	Morgan Stanley & Co. Incorporated
100,000	USVS	10/30	OIS	SOFR 1D	3.677%	2,285	Morgan Stanley & Co. Incorporated
200,000	USVS	10/30	OIS	SOFR 1D	3.664%	4,721	Morgan Stanley & Co. Incorporated
300,000	USVS	10/30	OIS	SOFR 1D	3.691%	6,603	Morgan Stanley & Co. Incorporated
300,000	USVS	10/30	OIS	SOFR 1D	3.735%	5,825	Morgan Stanley & Co. Incorporated
500,000	USVS	10/30	OIS	SOFR 1D	3.722%	10,099	Morgan Stanley & Co. Incorporated
200,000	USVS	10/30	OIS	SOFR 1D	3.739%	3,837	Morgan Stanley & Co. Incorporated
100,000	GBVS	03/34	OIS	SONIA 1D	3.700%	2,307	Morgan Stanley & Co. Incorporated
100,000	USVS	04/34	OIS	4.080%	SOFR 1D	967	Morgan Stanley & Co. Incorporated
200,000	USVS	04/34	OIS	4.150%	SOFR 1D	3,132	Morgan Stanley & Co. Incorporated
100,000	USVS	04/34	OIS	4.085%	SOFR 1D	1,029	Morgan Stanley & Co. Incorporated
400,000	USVS	04/34	OIS	4.078%	SOFR 1D	4,000	Morgan Stanley & Co. Incorporated
200,000	USVS	04/34	OIS	4.090%	SOFR 1D	2,206	Morgan Stanley & Co. Incorporated
5,500,000	USVS	12/29	OIS	SOFR 1D	3.750%	33,496	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,750,000	GBVS	09/29	OIS	4.000%	SONIA 1D	8,645	Morgan Stanley & Co. Incorporated
2,150,000	GBVS	09/29	OIS	4.000%	SONIA 1D	10,621	Morgan Stanley & Co. Incorporated
26,599,935	BRVS	01/27	NDIRS	CDI 1D	11.691%	11,793	Morgan Stanley & Co. Incorporated

Razem 2,514,937

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

Ilość	Waluta	Data zapadalności	Opis	Stopa procentowa otrzymana	Stopa procentowa zapłacona	Niezrealizowany zysk/(strata) EUR	Druga strona kontraktu
300,000	EUVS	04/27	IRS	0.700%	EURIBOR 6M	(22,273)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
600,000	EUVS	04/27	IRS	0.650%	EURIBOR 6M	(45,290)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
500,000	EUVS	05/27	IRS	0.650%	EURIBOR 6M	(37,056)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
700,000	EUVS	05/27	IRS	1.000%	EURIBOR 6M	(44,509)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
3,300,000	PLVS	09/27	IRS	WIBOR 6M	6.310%	(55,546)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
3,200,000	PLVS	09/27	IRS	WIBOR 6M	6.270%	(52,688)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
2,800,000	PLVS	09/27	IRS	WIBOR 6M	6.240%	(45,378)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
3,400,000	PLVS	09/27	IRS	WIBOR 6M	6.250%	(55,411)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
4,900,000	PLVS	09/27	IRS	WIBOR 6M	6.280%	(81,349)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
4,700,000	PLVS	10/27	IRS	WIBOR 6M	6.985%	(108,726)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
2,400,000	PLVS	10/27	IRS	WIBOR 6M	7.156%	(59,439)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
3,300,000	PLVS	09/27	IRS	WIBOR 6M	6.160%	(50,908)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
5,400,000	PLVS	02/29	IRS	4.810%	WIBOR 6M	(15,789)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
4,000,000	PLVS	02/29	IRS	4.641%	WIBOR 6M	(19,001)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
100,000	EUVS	03/34	IRS	2.760%	EURIBOR 6M	(967)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
100,000	EUVS	03/34	IRS	2.750%	EURIBOR 6M	(1,059)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,100,000	EUVS	09/34	IRS	2.750%	EURIBOR 6M	(4,560)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,100,000	EUVS	09/34	IRS	2.750%	EURIBOR 6M	(4,560)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,650,000	EUVS	09/34	IRS	2.750%	EURIBOR 6M	(6,840)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,650,000	EUVS	09/34	IRS	2.750%	EURIBOR 6M	(6,840)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
3,400,000	PLVS	03/29	IRS	4.970%	WIBOR 6M	(3,074)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
1,700,000	PLVS	03/29	IRS	4.970%	WIBOR 6M	(1,537)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
6,900,000	PLVS	03/27	IRS	5.160%	WIBOR 6M	(4,402)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
3,500,000	PLVS	03/27	IRS	5.158%	WIBOR 6M	(2,267)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
3,400,000	PLVS	03/27	IRS	5.158%	WIBOR 6M	(2,202)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
200,000	EUVS	04/29	IRS	2.770%	EURIBOR 6M	(1,580)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
100,000	EUVS	04/29	IRS	2.860%	EURIBOR 6M	(312)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
300,000	EUVS	04/34	IRS	2.770%	EURIBOR 6M	(2,048)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
300,000	USVS	02/30	OIS	3.470%	SOFR 1D	(10,290)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
100,000	USVS	02/53	OIS	3.080%	SOFR 1D	(12,064)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
700,000	USVS	06/26	OIS	0.500%	SOFR 1D	(57,816)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
800,000	USVS	03/25	OIS	0.613%	SOFR 1D	(26,648)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
2,200,000	USVS	03/25	OIS	0.622%	SOFR 1D	(72,874)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
8,500,000	CADS	06/25	OIS	4.000%	REPO CORRA 1D	(22,812)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
5,300,000	CADS	06/25	OIS	4.000%	REPO CORRA 1D	(14,224)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
300,000	USVS	10/24	OIS	3.018%	SOFR 1D	(7,275)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
300,000	USVS	10/24	OIS	3.140%	SOFR 1D	(6,905)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
300,000	USVS	10/24	OIS	3.190%	SOFR 1D	(6,755)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
300,000	USVS	10/24	OIS	3.225%	SOFR 1D	(6,651)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
300,000	USVS	10/24	OIS	2.973%	SOFR 1D	(7,421)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
8,000,000	USVS	10/28	OIS	2.000%	SOFR 1D	(798,719)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
300,000	USVS	10/24	OIS	2.841%	SOFR 1D	(7,785)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
500,000	CADS	06/32	OIS	REPO CORRA 1D	3.500%	(2,297)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
200,000	CADS	06/32	OIS	REPO CORRA 1D	3.500%	(919)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
100,000	CADS	06/32	OIS	REPO CORRA 1D	3.500%	(459)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
200,000	CADS	06/32	OIS	REPO CORRA 1D	3.500%	(919)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
200,000	CADS	06/32	OIS	REPO CORRA 1D	3.500%	(919)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
300,000	CADS	06/32	OIS	REPO CORRA 1D	3.500%	(1,378)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
200,000	USVS	12/33	OIS	SOFR 1D	4.030%	(47)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
200,000	USVS	12/33	OIS	SOFR 1D	4.030%	(47)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
200,000	USVS	01/34	OIS	3.620%	SOFR 1D	(6,368)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
10,000,000	JPVS	09/28	OIS	TONAR 1D	0.550%	(52)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
150,000,000	JPVS	09/28	OIS	TONAR 1D	0.550%	(782)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
620,000,000	JPVS	09/28	OIS	TONAR 1D	0.550%	(3,230)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
170,000,000	JPVS	09/28	OIS	TONAR 1D	0.550%	(886)	Morgan Stanley & Co. Incorporated

SANTANDER SICAV

Spółka inwestycyjna o kapitale zmiennym

300,000	USVS	02/34	OIS	3.860%	SOFR 1D	(3,284)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
100,000	USVS	03/34	OIS	3.650%	SOFR 1D	(2,779)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
300,000	USVS	03/34	OIS	3.700%	SOFR 1D	(7,093)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
400,000	USVS	04/34	OIS	3.900%	SOFR 1D	(2,194)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
300,000	USVS	06/34	OIS	SOFR 1D	4.080%	(3,513)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
24,292,592	BRVS	01/27	NDIRS	10.768%	CDI 1D	(102,865)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
2,653,746	BRVS	01/27	NDIRS	11.496%	CDI 1D	(3,163)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
14,168,158	BRVS	01/27	NDIRS	11.566%	CDI 1D	(12,892)	Morgan Stanley & Co. Incorporated
Razem						(1,949,936)	

Nota 16 – Umowy z przyrzeczeniem odkupu

Na dzień 30 czerwca 2024 roku subfundusz SANTANDER GO DYNAMIC BOND zawarł kontrakty z przyrzeczeniem odkupu, których kwota została ujawniona poniżej w walucie Subfunduszu, na mocy których pożyczka określoną kwotę 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	16,300,000	RRGOVBOND 5.34 175021 01	BofA Securities, Inc.	16,300,000	16,626,000

Nota 17 – Globalny przegląd zabezpieczeń

Na dzień 30 czerwca 2024 roku kontrahenci umów swap ustanowili na rzecz Spółki następujące zabezpieczenia:

Subfundusz	Waluta	Zabezpieczenie poza rynkiem regulowanym	Typ zabezpieczenia	Druga strona)
SANTANDER GO DYNAMIC BOND	USD	978,000	gotówka	Morgan Stanley Europe SE
SANTANDER GO DYNAMIC BOND	USD	220,000	gotówka	Barclays Bank London
SANTANDER GO DYNAMIC BOND	USD	360,000	gotówka	Goldman Sachs Bank Europe SE
SANTANDER GO DYNAMIC BOND	USD	20,000	gotówka	Morgan Stanley Europe SE
SANTANDER GO DYNAMIC BOND	USD	10,000	gotówka	The Toronto-Dominion Bank
SANTANDER GO DYNAMIC BOND	EUR	1,800,000	DE0001102390 - GERMANY BUND 0.50% 15/02/2026	J.P. Morgan SE
SANTANDER FUTURE WEALTH	USD	1,484,000	DE0001141836 - GERMANY BUND 0.00% 10/04/2026	J.P. Morgan SE
SANTANDER SELECT INCOME	EUR	1,493,000	FR0013508470 - OAT 0.00% 25/02/2026	J.P. Morgan SE

Nota 18 – wartość inwestycji pomiędzy Subfunduszami

Na dzień 30 czerwca 2024 roku ogólna wartość inwestycji pomiędzy Subfunduszami wyniosła 26,746,609 EUR w związku z tym ogólne skonsolidowane aktywa netto na koniec bez ww. pozycji wyniosły 4,785,445,577 EUR.

Nota 19 – Istotne wydarzenia

21 maja 2024 roku SANTANDER COVERED BOND został przekształcony w SANTANDER GO GLOBAL ENVIRONMENTAL SOLUTIONS, od tej daty BNP Paribas Asset Management UK Limited zastąpił Santander Asset Management SFIIC S.A. w roli podmiotu zarządzającego subfunduszem.

Nota 20 – Nadchodzące wydarzenia

9 lipca 2024 roku został utworzony subfundusz SANTANDER TARGET MATURITY EURO III.

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 2024 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 2024 r. przepisom niniejszego Rozporządzenia podlegały transakcje swapów total return.

SANTANDER GO DYNAMIC BOND

	USD
Kwota umów z udzielonym przyrzeczeniem odkupu wyrażona w wartościach bezwzględnych	16,300,000
Udział w wartości zarządzanych aktywów	13.50%
Termin zapadalności umów z przyrzeczeniem odkupu w rozbiciu na następujące przedziały czasowe (wartości bezwzględne)	
Poniżej jednego dnia	-
Jeden dzień do jednego tygodnia	16,300,000
Jeden tydzień do jednego miesiąca	-
Jeden do trzech miesięcy	-
Trzy miesiące do roku	-
Powyżej jednego roku	-
Termin otwarty	-
Razem	16,300,000
Druga strona umowy	
Nazwa drugiej strony kontraktu	Patrz nota 16
Kraj domicylu drugiej strony umowy	Patrz nota 16
Wolumen nierozliczonych transakcji brutto	13,200,000
Informacje o zabezpieczeniu	
Rodzaj zabezpieczenia:	
Srodki pieniężne	-
Papiery wartościowe	16,300,000
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	16,300,000
Termin otwarty	-
Razem	16,300,000
Przechowywanie zabezpieczeń otrzymanego przez fundusz w ramach umów z przyrzeczeniem odkupu	
Nazwa depozytariusza	BofA Securities, Inc.
Srodki pieniężne	-
Papiery wartościowe	16,300,000

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.