

ABACO RENTA FIJA MIXTA GLOBAL, FI

Nº Registro CNMV: 4474

Informe Trimestral del Tercer Trimestre 2022

Gestora: 1) ABACO CAPITAL, SGIIC, S.A. **Depositario:** SINGULAR BANK, S.A. **Auditor:**
PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDITORES SL

Grupo Gestora: **Grupo Depositario:** SINGULAR BANK **Rating Depositario:** n.d.

El presente informe, junto con los últimos informes periódicos, se encuentran disponibles por medios telemáticos en www.abaco-capital.com.

La Entidad Gestora atenderá las consultas de los clientes, relacionadas con las IIC gestionadas en:

Dirección

PASEO GENERAL MARTINEZ CAMPOS, 47 2º IZQ 28010 MADRID

Correo Electrónico

<mailto:abaco@abaco-capital.com>

Asimismo cuenta con un departamento o servicio de atención al cliente encargado de resolver las quejas y reclamaciones. La CNMV también pone a su disposición la Oficina de Atención al Inversor (902 149 200, e-mail: inversores@cnmv.es).

INFORMACIÓN FONDO

Fecha de registro: 11/05/2012

1. Política de inversión y divisa de denominación

Categoría

Tipo de fondo:

Otros

Vocación inversora: Renta Fija Mixto Internacional

Perfil de Riesgo: Alto

Descripción general

Política de inversión: Fondo de Inversión Renta Fija Mixta Internacional. El fondo de inversión busca preservar el valor del capital en el tiempo, cubriendo el efecto de la inflación sobre el capital, y obteniendo una rentabilidad extra en el medio-largo plazo. Puede invertir hasta un 30% de su exposición total en valores de renta variable, manteniendo el resto de su cartera en valores de renta fija pública y/o privada. La exposición a divisa podrá oscilar entre 0%-50% de la exposición total.

Operativa en instrumentos derivados

La metodología aplicada para calcular la exposición total al riesgo de mercado es el método del compromiso

Una información más detallada sobre la política de inversión del Fondo se puede encontrar en su folleto informativo.

Divisa de denominación EUR

2. Datos económicos

	Periodo actual	Periodo anterior	2022	2021
Índice de rotación de la cartera	0,00	0,06	0,62	1,02
Rentabilidad media de la liquidez (% anualizado)	-0,06	-0,24	-0,15	-0,05

Nota: El período se refiere al trimestre o semestre, según sea el caso. En el caso de IIC cuyo valor liquidativo no se determine diariamente, éste dato y el de patrimonio se refieren a los últimos disponibles

2.1.a) Datos generales.

Cuando no exista información disponible las correspondientes celdas aparecerán en blanco

CLASE	Nº de participaciones		Nº de partícipes		Divisa	Beneficios brutos distribuidos por participación		Inversión mínima	Distribuye dividendos
	Periodo actual	Periodo anterior	Periodo actual	Periodo anterior		Periodo actual	Periodo anterior		
I	6.119.253,63	5.990.766,45	153,00	156,00	EUR	0,00	0,00		NO
R	640.041,48	627.222,71	165,00	168,00	EUR	0,00	0,00	1,000000 Part.	NO
C	361.176,05	363.302,12	37,00	39,00	EUR	0,00	0,00		NO

Patrimonio (en miles)

CLASE	Divisa	Al final del periodo	Diciembre 2021	Diciembre 2020	Diciembre 2019
I	EUR	44.831	42.349	38.883	54.823
R	EUR	4.641	3.455	3.235	4.204
C	EUR	2.620	2.504	2.900	5.671

Valor liquidativo de la participación (*)

CLASE	Divisa	Al final del periodo	Diciembre 2021	Diciembre 2020	Diciembre 2019
I	EUR	7,3263	7,1337	6,1919	6,6525
R	EUR	7,2505	7,0700	6,1489	6,6195
C	EUR	7,2554	7,0904	6,1474	6,6478

(*)El valor liquidativo y, por tanto, su rentabilidad no recogen el efecto derivado del cargo individual al partícipe de la comisión de gestión sobre resultados:

Comisiones aplicadas en el período, sobre patrimonio medio

CLASE	Sist. Imputac.	Comisión de gestión						Base de cálculo	Comisión de depositario		
		% efectivamente cobrado							% efectivamente cobrado		Base de cálculo
		Periodo			Acumulada				Periodo	Acumulada	
		s/patrimonio	s/resultados	Total	s/patrimonio	s/resultados	Total				
I	al fondo	0,18	-0,10	0,08	0,52	0,12	0,64	mixta	0,02	0,06	Patrimonio
R	al fondo	0,23	-0,10	0,13	0,67	0,06	0,73	mixta	0,02	0,06	Patrimonio
C	al fondo	0,34		0,34	1,01		1,01	patrimonio	0,02	0,06	Patrimonio

2.2 Comportamiento

Cuando no exista información disponible las correspondientes celdas aparecerán en blanco

A) Individual / Divisa EUR

Rentabilidad (% sin anualizar)	Acumulado 2022	Trimestral				Anual			
		Último trim (0)	Trim-1	Trim-2	Trim-3	2021	2020	2019	2017
Rentabilidad IIC	2,70	-1,95	0,26	4,47	-0,38	15,21	-6,92	8,27	3,90

Rentabilidades extremas (i)	Trimestre actual		Último año		Últimos 3 años	
	%	Fecha	%	Fecha	%	Fecha
Rentabilidad mínima (%)	-1,31	05-07-2022	-1,45	09-05-2022	-4,81	12-03-2020
Rentabilidad máxima (%)	0,75	07-07-2022	1,09	04-04-2022	4,34	09-11-2020

(i) Sólo se informa para las clases con una antigüedad mínima del periodo solicitado y siempre que no se haya modificado su vocación inversora

Se refiere a las rentabilidades máximas y mínimas entre dos valores liquidativos consecutivos.

La periodicidad de cálculo del valor liquidativo es *diaria*

Recuerde que rentabilidades pasadas no presuponen rentabilidades futuras. Sólo se informa si se ha mantenido una política de inversión homogénea en el período.

Medidas de riesgo (%)	Acumulado 2022	Trimestral				Anual			
		Último trim (0)	Trim-1	Trim-2	Trim-3	2021	2020	2019	2017
Volatilidad(ii) de:									
Valor liquidativo	6,74	5,94	7,95	6,20	7,77	7,77	16,13	7,13	2,75
Ibex-35	20,77	16,32	19,79	25,56	19,53	16,67	34,37	12,50	13,00
Letra Tesoro 1 año	1,12	1,78	0,61	0,41	0,25	0,28	0,54	0,25	0,60
VaR histórico del valor liquidativo(iii)	7,89	7,89	7,84	7,75	7,76	7,76	7,75	4,70	3,02

(ii) Volatilidad histórica: Indica el riesgo de un valor en un periodo, a mayor volatilidad mayor riesgo. A modo comparativo se ofrece la volatilidad de distintas referencias. Sólo se informa de la volatilidad para los períodos con política de inversión homogénea.

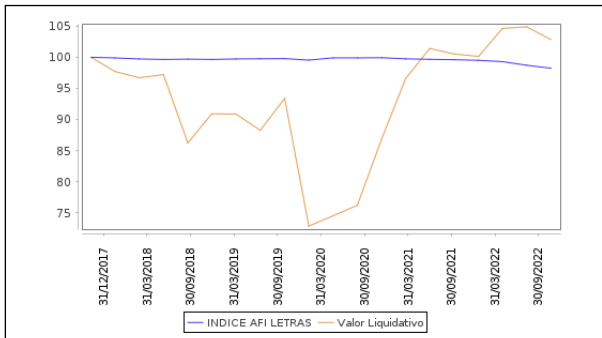
(iii) VaR histórico del valor liquidativo: Indica lo máximo que se puede perder, con un nivel de confianza del 99%, en el plazo de 1 mes, si se repitiese el comportamiento de la IIC de los últimos 5 años. El dato es a finales del periodo de referencia.

Gastos (% s/ patrimonio medio)	Acumulado 2022	Trimestral				Anual			
		Último trim (0)	Trim-1	Trim-2	Trim-3	2021	2020	2019	2017
Ratio total de gastos (iv)	0,65	0,20	0,21	0,24	0,21	0,83	0,84	0,81	0,83

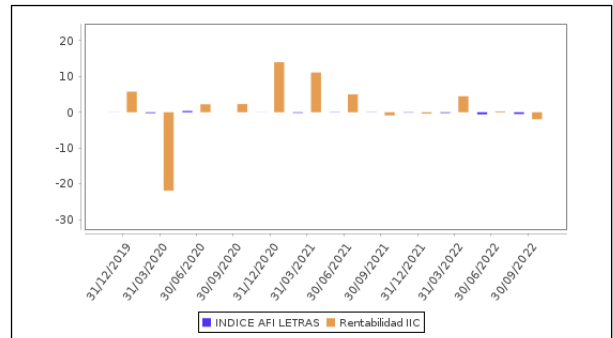
(iv) Incluye los gastos directos soportados en el periodo de referencia: comisión de gestión sobre patrimonio, comisión de depositario, auditoría, servicios bancarios (salvo gastos de financiación), y resto de gastos de gestión corriente, en términos de porcentaje sobre patrimonio medio del periodo. En el caso de fondos/compartimentos que invierten más de un 10% de su patrimonio en otras IIC este ratio incluye, de forma adicional al anterior, los gastos soportados indirectamente, derivados de esas inversiones, que incluyen las comisiones de suscripción y reembolso. Este ratio no incluye la comisión de gestión sobre resultados ni los costes de transacción por la compraventa de valores.

En el caso de inversiones en IIC que no calculan su ratio de gastos, éste se ha estimado para incorporarlo en el ratio de gastos.

Evolución del valor liquidativo últimos 5 años



Rentabilidad trimestral de los últimos 3 años



A) Individual R .Divisa EUR

Rentabilidad (% sin anualizar)	Acumulado 2022	Trimestral				Anual			
		Último trim (0)	Trim-1	Trim-2	Trim-3	2021	2020	2019	2017
Rentabilidad IIC	2,55	-2,00	0,21	4,43	-0,41	14,98	-7,11	8,06	3,68

Rentabilidades extremas (i)	Trimestre actual		Último año		Últimos 3 años	
	%	Fecha	%	Fecha	%	Fecha
Rentabilidad mínima (%)	-1,32	05-07-2022	-1,46	09-05-2022	-4,81	12-03-2020
Rentabilidad máxima (%)	0,75	07-07-2022	1,09	04-04-2022	4,34	09-11-2020

(i) Sólo se informa para las clases con una antigüedad mínima del periodo solicitado y siempre que no se haya modificado su vocación inversora

Se refiere a las rentabilidades máximas y mínimas entre dos valores liquidativos consecutivos.

La periodicidad de cálculo del valor liquidativo es *diaria*

Recuerde que rentabilidades pasadas no presuponen rentabilidades futuras. Sólo se informa si se ha mantenido una política de inversión homogénea en el período.

Medidas de riesgo (%)	Acumulado 2022	Trimestral				Anual			
		Último trim (0)	Trim-1	Trim-2	Trim-3	2021	2020	2019	2017
Volatilidad(ii) de:									
Valor liquidativo	6,74	5,94	7,95	6,20	7,75	7,77	16,13	7,13	2,78
Ibex-35	20,77	16,32	19,79	25,56	19,53	16,67	34,37	12,50	13,00
Letra Tesoro 1 año	1,12	1,78	0,61	0,41	0,25	0,28	0,54	0,25	0,60
VaR histórico del valor liquidativo(iii)	7,90	7,90	7,85	7,77	7,77	7,77	8,22	4,51	1,29

(ii) Volatilidad histórica: Indica el riesgo de un valor en un periodo, a mayor volatilidad mayor riesgo. A modo comparativo se ofrece la volatilidad de distintas referencias. Sólo se informa de la volatilidad para los períodos con política de inversión homogénea.

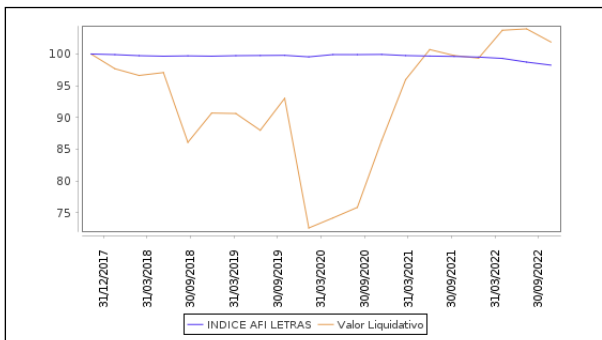
(iii) VaR histórico del valor liquidativo: Indica lo máximo que se puede perder, con un nivel de confianza del 99%, en el plazo de 1 mes, si se repitiese el comportamiento de la IIC de los últimos 5 años. El dato es a finales del periodo de referencia.

Gastos (% s/ patrimonio medio)	Acumulado 2022	Trimestral				Anual			
		Último trim (0)	Trim-1	Trim-2	Trim-3	2021	2020	2019	2017
Ratio total de gastos (iv)	0,80	0,25	0,26	0,29	0,26	1,03	1,04	1,01	1,03

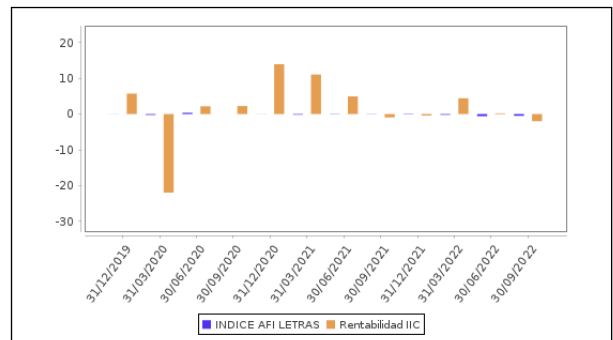
(iv) Incluye los gastos directos soportados en el periodo de referencia: comisión de gestión sobre patrimonio, comisión de depositario, auditoría, servicios bancarios (salvo gastos de financiación), y resto de gastos de gestión corriente, en términos de porcentaje sobre patrimonio medio del periodo. En el caso de fondos/compartimentos que invierten más de un 10% de su patrimonio en otras IIC este ratio incluye, de forma adicional al anterior, los gastos soportados indirectamente, derivados de esas inversiones, que incluyen las comisiones de suscripción y reembolso. Este ratio no incluye la comisión de gestión sobre resultados ni los costes de transacción por la compraventa de valores.

En el caso de inversiones en IIC que no calculan su ratio de gastos, éste se ha estimado para incorporarlo en el ratio de gastos.

Evolución del valor liquidativo últimos 5 años



Rentabilidad trimestral de los últimos 3 años



A) Individual C .Divisa EUR

Rentabilidad (% sin anualizar)	Acumulado 2022	Trimestral				Anual			
		Último trim (0)	Trim-1	Trim-2	Trim-3	2021	2020	2019	Año t-5
Rentabilidad IIC	2,33	-2,21	0,10	4,53	-0,57	15,34	-7,53	7,57	

Rentabilidades extremas (i)	Trimestre actual		Último año		Últimos 3 años	
	%	Fecha	%	Fecha	%	Fecha
Rentabilidad mínima (%)	-1,38	05-07-2022	-1,53	09-05-2022	-4,82	12-03-2020
Rentabilidad máxima (%)	0,78	07-07-2022	1,14	04-04-2022	4,34	09-11-2020

(i) Sólo se informa para las clases con una antigüedad mínima del periodo solicitado y siempre que no se haya modificado su vocación inversora

Se refiere a las rentabilidades máximas y mínimas entre dos valores liquidativos consecutivos.

La periodicidad de cálculo del valor liquidativo es *diaria*

Recuerde que rentabilidades pasadas no presuponen rentabilidades futuras. Sólo se informa si se ha mantenido una política de inversión homogénea en el período.

Medidas de riesgo (%)	Acumulado 2022	Trimestral				Anual			
		Último trim (0)	Trim-1	Trim-2	Trim-3	2021	2020	2019	Año t-5
Volatilidad(ii) de:									
Valor liquidativo	7,08	6,23	8,36	6,51	8,24	8,22	16,13	7,13	
Ibex-35	20,77	16,32	19,79	25,56	19,53	16,67	34,37	12,50	
Letra Tesoro 1 año	1,12	1,78	0,61	0,41	0,25	0,28	0,54	0,25	
VaR histórico del valor liquidativo(iii)	8,15	8,15	8,30	8,43	8,72	8,72	9,69	5,64	

(ii) Volatilidad histórica: Indica el riesgo de un valor en un periodo, a mayor volatilidad mayor riesgo. A modo comparativo se ofrece la volatilidad de distintas referencias. Sólo se informa de la volatilidad para los períodos con política de inversión homogénea.

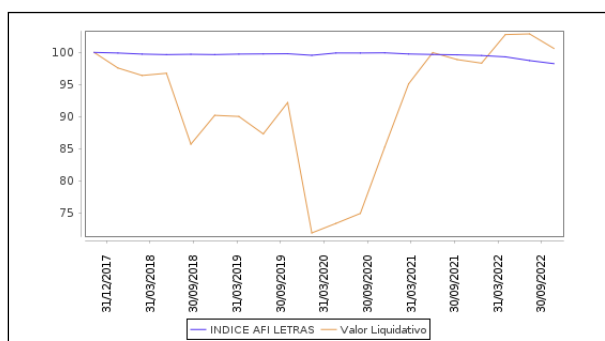
(iii) VaR histórico del valor liquidativo: Indica lo máximo que se puede perder, con un nivel de confianza del 99%, en el plazo de 1 mes, si se repitiese el comportamiento de la IIC de los últimos 5 años. El dato es a finales del periodo de referencia.

Gastos (% s/ patrimonio medio)	Acumulado 2022	Trimestral				Anual			
		Último trim (0)	Trim-1	Trim-2	Trim-3	2021	2020	2019	2017
Ratio total de gastos (iv)	1,14	0,37	0,37	0,40	0,37	1,48	1,49	1,46	0,11

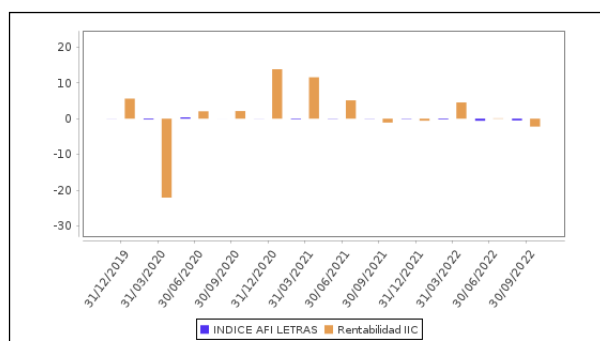
(iv) Incluye los gastos directos soportados en el periodo de referencia: comisión de gestión sobre patrimonio, comisión de depositario, auditoría, servicios bancarios (salvo gastos de financiación), y resto de gastos de gestión corriente, en términos de porcentaje sobre patrimonio medio del periodo. En el caso de fondos/compartimentos que invierten más de un 10% de su patrimonio en otras IIC este ratio incluye, de forma adicional al anterior, los gastos soportados indirectamente, derivados de esas inversiones, que incluyen las comisiones de suscripción y reembolso. Este ratio no incluye la comisión de gestión sobre resultados ni los costes de transacción por la compraventa de valores.

En el caso de inversiones en IIC que no calculan su ratio de gastos, éste se ha estimado para incorporarlo en el ratio de gastos.

Evolución del valor liquidativo últimos 5 años



Rentabilidad trimestral de los últimos 3 años



B) Comparativa

Durante el periodo de referencia, la rentabilidad media en el periodo de referencia de los fondos gestionados por la Sociedad Gestora se presenta en el cuadro adjunto. Los fondos se agrupan según su vocación inversora.

Vocación inversora	Patrimonio gestionado* (miles de euros)	Nº de partícipes*	Rentabilidad Trimestral media**
Renta Fija Euro	0	0	0
Renta Fija Internacional	4.498	100	0
Renta Fija Mixta Euro	0	0	0
Renta Fija Mixta Internacional	52.831	365	-2
Renta Variable Mixta Euro	0	0	0
Renta Variable Mixta Internacional	0	0	0
Renta Variable Euro	0	0	0
Renta Variable Internacional	0	0	0
IIC de Gestión Pasiva	0	0	0
Garantizado de Rendimiento Fijo	0	0	0
Garantizado de Rendimiento Variable	0	0	0
De Garantía Parcial	0	0	0
Retorno Absoluto	0	0	0
Global	45.411	421	-6
FMM a Corto Plazo de Valor Liquidativo Variable	0	0	0
FMM a Corto Plazo de Valor Liq. Constante de Deuda Pública	0	0	0
FMM a Corto Plazo de Valor Liquidativo de Baja Volatilidad	0	0	0
FMM Estándar de Valor Liquidativo Variable	0	0	0
Renta Fija Euro Corto Plazo	0	0	0
IIC que Replica un Índice	0	0	0

Vocación inversora	Patrimonio gestionado* (miles de euros)	Nº de partícipes*	Rentabilidad Trimestral media**
IIC con Objetivo Concreto de Rentabilidad No Garantizado	0	0	0
Total fondos	102.740	886	-3,60

*Medias.

**Rentabilidad media ponderada por patrimonio medio de cada FI en el periodo

2.3 Distribución del patrimonio al cierre del período (Importes en miles de EUR)

Distribución del patrimonio	Fin período actual		Fin período anterior	
	Importe	% sobre patrimonio	Importe	% sobre patrimonio
(+) INVERSIONES FINANCIERAS	41.583	79,82	46.721	89,68
* Cartera interior	8.108	15,56	9.755	18,72
* Cartera exterior	32.969	63,29	36.680	70,41
* Intereses de la cartera de inversión	506	0,97	286	0,55
* Inversiones dudosas, morosas o en litigio	0	0,00	0	0,00
(+) LIQUIDEZ (TESORERÍA)	8.904	17,09	4.179	8,02
(+/-) RESTO	1.605	3,08	1.198	2,30
TOTAL PATRIMONIO	52.093	100,00 %	52.098	100,00 %

Notas:

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

Las inversiones financieras se informan a valor e estimado de realización.

2.4 Estado de variación patrimonial

	% sobre patrimonio medio			% variación respecto fin periodo anterior
	Variación del período actual	Variación del periodo anterior	Variación acumulada anual	
PATRIMONIO FIN PERIODO ANTERIOR (miles de EUR)	52.098	50.649	48.309	
± Suscripciones/ reembolsos (neto)	1,97	2,59	4,97	-22,68
- Beneficios brutos distribuidos	0,00	0,00	0,00	0,00
± Rendimientos netos	-1,98	0,21	2,35	5.053.204,24
(+) Rendimientos de gestión	-1,88	0,46	3,20	6.293,86
+ Intereses	0,89	0,84	2,71	7,69
+ Dividendos	0,22	0,32	0,72	-30,02
± Resultados en renta fija (realizadas o no)	1,18	-1,07	0,28	-211,66
± Resultados en renta variable (realizadas o no)	-2,84	0,15	-1,28	-2.022,31
± Resultados en depósitos (realizadas o no)	0,00	0,00	0,00	0,00
± Resultado en derivados (realizadas o no)	-1,70	-0,02	-0,13	8.559,85
± Resultado en IIC (realizados o no)	0,00	0,00	0,00	-68,64
± Otros resultados	0,37	0,24	0,90	58,95
± Otros rendimientos	0,00	0,00	0,00	0,00
(-) Gastos repercutidos	-0,12	-0,25	-0,87	-153,26
- Comisión de gestión	-0,10	-0,20	-0,67	-50,23
- Comisión de depositario	-0,02	-0,02	-0,06	2,79
- Gastos por servicios exteriores	-0,01	-0,01	-0,03	-41,88
- Otros gastos de gestión corriente	0,00	0,00	-0,04	63,28
- Otros gastos repercutidos	0,01	-0,02	-0,07	-127,22
(+) Ingresos	0,02	0,00	0,02	5.047.063,64
+ Comisiones de descuento a favor de la IIC	0,00	0,00	0,00	0,00
+ Comisiones retrocedidas	0,00	0,00	0,00	0,00
+ Otros ingresos	0,02	0,00	0,02	5.047.063,64
PATRIMONIO FIN PERIODO ACTUAL (miles de EUR)	52.093	52.098	52.093	

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

3. Inversiones financieras

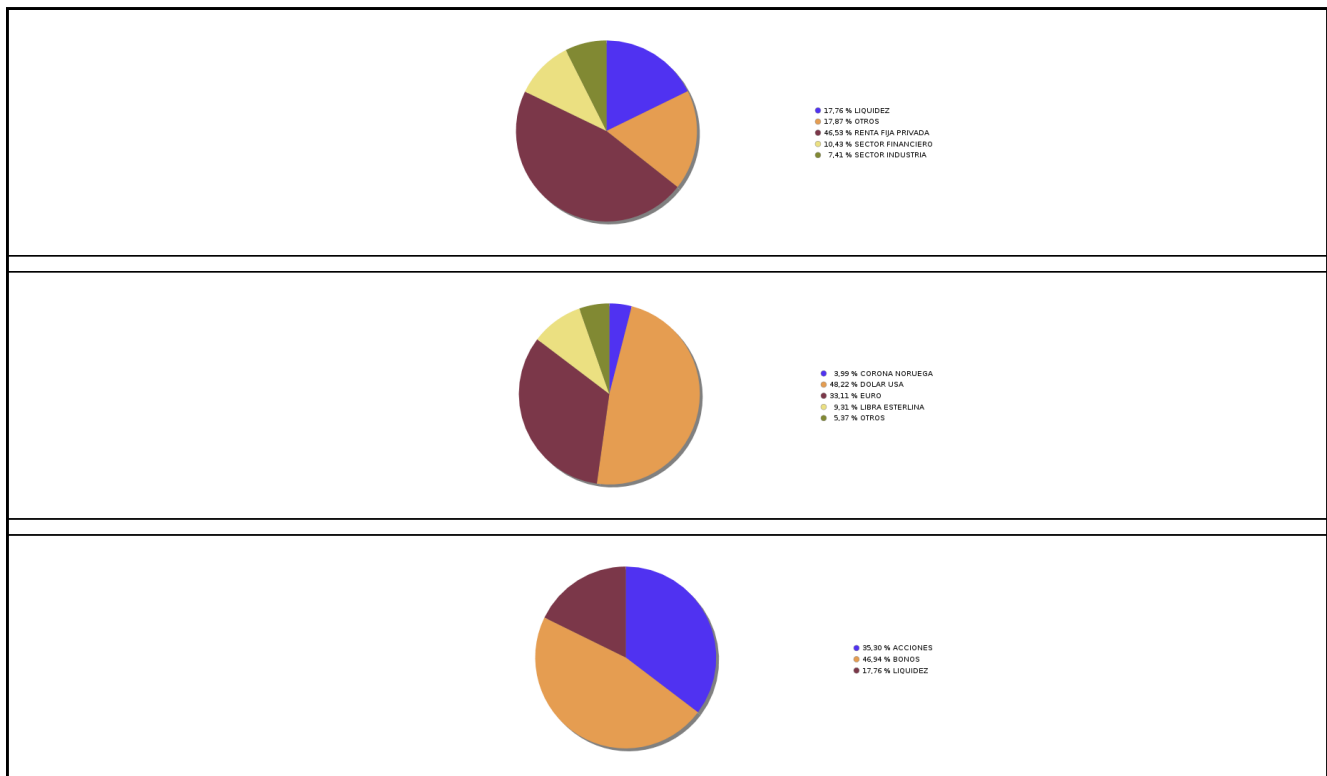
3.1 Inversiones financieras a valor estimado de realización (en miles de EUR) y en porcentaje sobre el patrimonio, al cierre del periodo

Descripción de la inversión y emisor	Periodo actual		Periodo anterior	
	Valor de mercado	%	Valor de mercado	%
TOTAL RENTA FIJA COTIZADA	2.852	5,47	3.371	6,47
TOTAL RENTA FIJA	2.852	5,47	3.371	6,47
TOTAL RV COTIZADA	5.267	10,11	6.376	12,24
TOTAL RENTA VARIABLE	5.267	10,11	6.376	12,24
TOTAL IIC	0	0,00	8	0,02
TOTAL INVERSIONES FINANCIERAS INTERIOR	8.119	15,59	9.755	18,72
TOTAL RENTA FIJA COTIZADA	20.303	38,98	22.014	42,25
TOTAL RENTA FIJA	20.303	38,98	22.014	42,25
TOTAL RV COTIZADA	12.527	24,05	14.530	27,89
TOTAL RENTA VARIABLE	12.527	24,05	14.530	27,89
TOTAL INVERSIONES FINANCIERAS EXTERIOR	32.830	63,02	36.543	70,14
TOTAL INVERSIONES FINANCIERAS	40.949	78,61	46.298	88,87

Notas: El período se refiere al final del trimestre o semestre, según sea el caso.

Los productos estructurados suponen un 0,00% de la cartera de inversiones financieras del fondo o compartimento.

3.2 Distribución de las inversiones financieras, al cierre del período: Porcentaje respecto al patrimonio total



3.3 Operativa en derivados. Resumen de las posiciones abiertas al cierre del periodo (importes en miles de EUR)

Subyacente	Instrumento	Importe nominal comprometido	Objetivo de la inversión
DJ EUROSTOXX 50	Venta Futuro DJ EUROSTOXX 50 10	973	Cobertura

Subyacente	Instrumento	Importe nominal comprometido	Objetivo de la inversión
FTSE 100	Venta Futuro FTSE 100 10	787	Cobertura
SP 500 INDICE	Venta Futuro SP 500 INDICE 50	11.441	Cobertura
STOXX EUROPE 600 INDEX	Venta Futuro STOXX EUROPE 600 INDEX 50	781	Cobertura
Total subyacente renta variable		13983	
EURO- DOLAR	Compra Futuro EURO-DOLAR 125000	23.602	Cobertura
EURO-CHF	Compra Futuro EURO-CHF 125000	624	Cobertura
EURO-LIBRA	Compra Futuro EURO-LIBRA 125000	1.634	Cobertura
Total subyacente tipo de cambio		25859	
BUNDES OBLIGATION 0 15/08/2031	Venta Futuro BUNDES OBLIGATION 0 15/08/2031 1000 Fi	2.032	Cobertura
GASLOG PARTNERS 8,2% PERP CALL03/23CONVE	Compra Plazo GASLOG PARTNERS 8,2% PERP CALL03/23CO	241	Inversión
VEDANTA RESOURCES 8.00% 23/04/2023	Venta Plazo VEDANTA RESOURCES 8.00% 23/04/2023 357	326	Inversión
Total otros subyacentes		2599	
TOTAL OBLIGACIONES		42441	

4. Hechos relevantes

	SI	NO
a. Suspensión temporal de suscripciones/reembolsos		X
b. Reanudación de suscripciones/reembolsos		X
c. Reembolso de patrimonio significativo		X
d. Endeudamiento superior al 5% del patrimonio		X
e. Sustitución de la sociedad gestora		X
f. Sustitución de la entidad depositaria	X	
g. Cambio de control de la sociedad gestora		X
h. Cambio en elementos esenciales del folleto informativo		X
i. Autorización del proceso de fusión		X
j. Otros hechos relevantes		X

5. Anexo explicativo de hechos relevantes

--

Número de registro: 302272

Número de registro: 302198

6. Operaciones vinculadas y otras informaciones

	SI	NO
a. Partícipes significativos en el patrimonio del fondo (porcentaje superior al 20%)		X
b. Modificaciones de escasa relevancia en el Reglamento		X
c. Gestora y el depositario son del mismo grupo (según artículo 4 de la LMV)		X
d. Se han realizado operaciones de adquisición y venta de valores en los que el depositario ha actuado como vendedor o comprador, respectivamente		X
e. Se han adquirido valores o instrumentos financieros emitidos o avalados por alguna entidad del grupo de la gestora o depositario, o alguno de éstos ha actuado como colocador, asegurador, director o asesor, o se han prestado valores a entidades vinculadas.		X
f. Se han adquirido valores o instrumentos financieros cuya contrapartida ha sido otra una entidad del grupo de la gestora o depositario, u otra IIC gestionada por la misma gestora u otra gestora del grupo.	X	
g. Se han percibido ingresos por entidades del grupo de la gestora que tienen como origen comisiones o gastos satisfechos por la IIC.		X
h. Otras informaciones u operaciones vinculadas		X

7. Anexo explicativo sobre operaciones vinculadas y otras informaciones

Como vendedor por importe de 605.344,28 euros, suponiendo un 0.003 % sobre el sobre el patrimonio medio de la IIC en el período de referencia. Como comprador por importe de 177.056,55 euros, suponiendo un 0.00 % sobre el sobre el patrimonio medio de la IIC en el período de referencia.

8. Información y advertencias a instancia de la CNMV

No aplica.

9. Anexo explicativo del informe periódico

1. SITUACIÓN DE LOS MERCADOS. EVOLUCIÓN DEL FONDO Y PERSPECTIVAS

a) Visión de la gestora/sociedad sobre la situación de los mercados. La situación de mercado ha cambiado de forma radical en lo que llevamos de año. Las subidas de tipos de interés están siendo mucho más frecuentes y agresivas de lo esperado a principio de año, la inflación también está siendo más persistente y acentuada de lo estimado y la guerra en Ucrania ha empeorado la situación de ambos problemas. Estas subidas de tipos de interés, necesarias para controlar la inflación, están comenzando a hacer daño a muchos activos financieros y también a la propia economía. Un claro ejemplo de ello lo podemos observar en las hipotecas, muchas de ellas concedidas a tipo variable. El incremento de tipos de interés ha provocado una subida del Euribor y por tanto el coste de éstas. Todo este incremento en el gasto medio de los hogares destinado al pago de sus hipotecas es un gasto que está dejando de consumirse en otros productos y servicios o de invertirse para incrementar los ahorros, afectando de forma muy negativa a la economía. En los mercados financieros, este cambio de entorno ha provocado que los principales índices de renta variable de Estados Unidos y Europa hayan cedido un 24% y un 23% respectivamente. Y los activos de renta fija, también hayan sufrido caídas del 15%. Siendo el peor año de ambos activos en su conjunto, de los últimos 80 años. Durante los últimos 40 años hemos visto como los tipos de interés han ido disminuyendo de forma constante, la deuda de los países aumentando y la cantidad de dinero en circulación aumentando muy por encima del ritmo al que crecía la economía. Todos estos procesos se han visto acelerados durante los últimos 10 años y más aún durante estos dos últimos años posteriores a la pandemia. Estos problemas, junto con una crisis energética que se ha visto fuertemente acentuada debido a la guerra en Ucrania han provocado que nos encontremos con unos niveles de inflación no vistos en décadas. b) Decisiones generales de inversión

adoptadas. El fondo Abaco Renta Fija Mixta Global sigue una filosofía Value Investing, analizando empresas en toda su estructura de capital, para buscar activos infravalorados respecto a su cotización de mercado. En este sentido, las correcciones de precios nos han permitido ajustar algunos de los pesos de la cartera, para ponderar las ideas de inversión que ofrecen mayor descuento, e incorporar oportunidades adicionales con mayor potencial de revalorización. c) Índice de referencia El Fondo no tiene un índice de referencia, dado que realiza una gestión activa y flexible. d) Evolución del Patrimonio, participes, rentabilidad y gastos de la IIC. Este fondo, que inició su estrategia de gestión con la SICAV Arenberg (fusionada por absorción con el fondo en junio del 2017), cumplió este mes de julio quince años de estrategia. Desde el inicio acumula una rentabilidad del +90,47%, que en términos anualizados supone una rentabilidad del +4,65%. En el tercer trimestre del año el valor liquidativo de la clase I del fondo disminuyó en un 1,86%. Para la clase R del fondo, el valor liquidativo en el trimestre disminuyó un 2,00%. Por último, para la clase C, el valor liquidativo en el trimestre disminuyó un 2,21.%. El patrimonio del fondo a 30 de septiembre de 2022 se sitúa en 52.092.515,31 euros. Este se ha visto disminuido en un 0,01% con respecto al trimestre anterior. El número de participes, entre todas las clases, ha disminuido desde 363 a 355 suponiendo esto una disminución del 2,20%. El Fondo no tiene un índice de referencia, dado que realiza una gestión activa y flexible. Los gastos soportados por el fondo proceden, por una parte, de costes y gastos corrientes recurrentes como la comisión de gestión, depositaría y gastos relativos al mantenimiento de la inversión como auditoría y tasas CNMV; por otra parte, incluye también los costes y gastos operacionales y de intermediación de la cartera del fondo. Rentabilidades pasadas en ningún caso garantizan rentabilidades futuras.

2. INFORMACION SOBRE LAS INVERSIONES. Al final del tercer trimestre el fondo tenía una liquidez del 15,2%, una exposición a renta variable neta del 9,3% y una exposición a renta fija del 46,76% sobre el patrimonio. Las principales posiciones de renta fija del fondo son el bono de Golar LNG cupón del 7% y vencimiento en 2025, en USD, y el bono de Euronav con cupón del 6,25% y vencimiento en 2026. En la cartera de renta variable destacan las posiciones de Anheuser-Busch Inbev, Gestamp y FairFax India. Estas compañías están lideradas y dirigidas por equipos gestores excelentes, completamente alineados con nuestros intereses, que han generado un enorme valor para estas en el pasado y que así esperamos que lo continúen haciendo. Características que también comparten el resto de las posiciones de la cartera.

a) Inversiones concretas realizadas durante el periodo. En el tercer trimestre hemos reducido peso en compañías con un excelente comportamiento en los últimos meses, tanto en renta variable como en renta fija, y hemos hecho alguna rotación a ideas con un mayor potencial de revalorización. Hemos reducido las posiciones de Atalaya Mining, Burford Capital, Lloyds, Gestamp, Prosegur, Prosegur Cash y el bono de Vedanta Resources 2023 en renta fija. Durante el mismo periodo, hemos aumentado el peso de Compañía de Minas de Buenaventura en renta variable. Como nuevas ideas incorporadas en este último trimestre tenemos, en renta variable Kinross Gold. En renta fija hemos añadido a la cartera Gaslog Partners. Por último, durante este trimestre ha vencido el bono de International Seaways y en renta variable hemos cerrado las posiciones de Exmar NV, International Seaways, Allocation SICAV y Chart Inversiones. La cartera consta de treinta (30) bonos corporativos y cuarenta y uno (41) acciones. En Abaco Capital sabemos que es muy complicado batir al mercado si hacemos lo mismo, así que es necesario utilizar otros parámetros, en nuestro caso nos dedicamos a analizar las compañías, entenderlas, sólo comprarlas baratas y hacerlo con un horizonte temporal de largo plazo. Estamos convencidos de que la actual cartera del fondo tiene un gran descuento y compañías de calidad, con porcentajes de revalorización sobre el patrimonio superior al 100% en renta variable y con una rentabilidad superior al 8% en renta fija.

b) Operativa de préstamo de valores. El fondo no ha realizado ninguna operativa de préstamos de valores.

c) Utilización de derivados. El fondo utiliza derivados como cobertura. En este sentido, mantiene coberturas de divisa, del Euro-Dólar, Euro-Franco Suizo, Euro-libra y cobertura de tipo de interés mediante venta de futuros del bono alemán. También tenemos coberturas del mini S&P 500, Eurostoxx y FTSE 100.

d) Otra información sobre inversiones. No existen activos que se encuentren en circunstancias excepcionales (concurso, suspensión, litigio).

3. EVOLUCIÓN DEL OBJETIVO CONCRETO DE RENTABILIDAD N/A

4. RIESGO ASUMIDO POR EL FONDO. El fondo asume un riesgo relacionado directamente al nivel de concentración de las posiciones que tenemos en las ideas de mayor convicción. Si bien es cierto que hay posiciones con peso superior al 5%, no están correlacionadas entre sí, asegurándonos de que corresponden a ciclos o riesgos temporales distintos (como es el caso de las empresas de autos, aseguradoras, navieras) o distintas geografías (teniendo las mayores posiciones en

Canadá, Reino Unido, Estados Unidos y España).

5. EJERCICIO DERECHOS POLITICOS. Nuestra política de ejercicio de derechos de voto es delegar el mismo, salvo que se diera una situación especial que requiriera lo contrario.

6. INFORMACION Y ADVERTENCIAS CNMV. N/A

7. ENTIDADES BENEFICIARIAS DEL FONDO SOLIDARIO E IMPORTE CEDIDO A LAS MISMAS N/A

8. COSTES DERIVADOS DEL SERVICIO DE ANALISIS. El fondo puede soportar los gastos derivados del servicio de análisis financiero. La asunción de los referidos gastos no supone un aumento de los gastos totales del fondo o TER (ratio de gastos totales) ya que, al mismo tiempo, los gastos de intermediación que soporta el fondo se han visto minorados. Para el tercer trimestre de 2022, el importe de los gastos por este concepto ha supuesto un 0,0000457% sobre el patrimonio medio gestionado.

9. COMPARTIMENTOS DE PROPOSITO ESPECIAL (SIDE POCKETS). N/A

10. PERSPECTIVAS DE MERCADO Y ACTUACION PREVISIBLE DEL FONDO.

La situación económica de los próximos trimestres va a estar caracterizada por inflaciones altas, con crecimientos bajos e incertidumbre a nivel geopolítico. Aunque el mercado puede continuar viéndose afectado por la situación actual, estamos convencidos que las compañías que tenemos en cartera representan una excelente oportunidad de inversión para cualquier inversor, a medio y largo plazo. En renta fija estamos posicionados con duraciones muy cortas en las carteras, y en empresas con activos reales cuyo valor es más de dos veces superior al de su deuda, estando el crédito muy bien cubierto, con una posición de liquidez sólida y que además ofrecen una rentabilidad superior al 8%. En renta variable, todas las compañías tienen una posición competitiva muy fuerte, altos retornos sobre el capital invertido, son grandes generadoras de caja, son capaces de incrementar precios en sus productos, mantener sus márgenes operativos, sus negocios no tienen fuertes necesidades de inversión y cotizan con un gran margen de seguridad frente a su valor intrínseco. Ambas carteras están muy diversificadas geográficamente y tenemos posiciones de liquidez para aprovechar las oportunidades que este entorno pueda generar. Las ventas de nuestras compañías están distribuidas en América del Norte (35%), América del Sur (21%), Europa (18%), Reino Unido (14%) y Asia (13%). Como gestora continuamos trabajando día a día, analizando y comprendiendo mejor todos los negocios que tenemos en cartera y buscando las mejores oportunidades de inversión que nos ofrece el mercado, tanto en renta variable, como en renta fija. La inflación es un fenómeno que no experimentábamos desde hace un largo periodo de tiempo y para el que hemos estado preparándonos los últimos meses. Creemos que todo inversor y ahorrador debe tener como objetivo preservar e incrementar su poder adquisitivo, a lo largo de los años. Para nosotros la mejor forma de conseguir este objetivo es mediante la inversión en compañías con grandes ventajas competitivas, lideradas por excelentes equipos gestores y que cotizan con un gran margen de seguridad frente a su valor intrínseco. Nuestras carteras de renta fija también pensamos que nos ofrecen una oportunidad de inversión muy interesante en la actualidad.

12. Información sobre las operaciones de financiación de valores, reutilización de las garantías y swaps de rendimiento total (Reglamento UE 2015/2365). No se han realizado operaciones de financiación durante el periodo

10. Detalle de inversiones financieras

Descripción de la inversión y emisor	Divisa	Periodo actual		Periodo anterior	
		Valor de mercado	%	Valor de mercado	%
ES0305626006 - Bonos INSUR PROMOCION INTE 4,000 2026-12-10	EUR	728	1,40	808	1,55
ES0282870007 - Bonos SACYR INTL 4,500 2024-11-16	EUR	859	1,65	1.271	2,44
ES0213900220 - Bonos BSCH 0,249 2024-12-15	EUR	1.264	2,43	1.292	2,48
Total Renta Fija Privada Cotizada mas de 1 año		2.852	5,47	3.371	6,47
TOTAL RENTA FIJA COTIZADA		2.852	5,47	3.371	6,47
TOTAL RENTA FIJA		2.852	5,47	3.371	6,47
ES0105630315 - Acciones CIE AUTOMOTIVE SA	EUR	607	1,16	675	1,30
ES0105130001 - Acciones GLOBAL DOMINION	EUR	1.006	1,93	1.245	2,39
ES0105223004 - Acciones GESTAMP	EUR	1.377	2,64	1.791	3,44
ES0171996095 - Acciones GRIFOLS	EUR	273	0,52	477	0,92
ES0148396007 - Acciones INDITEX	EUR	7	0,01	7	0,01
ES0154653911 - Acciones INMOBILIRIA DEL SUR	EUR	169	0,32	182	0,35
ES0105229001 - Acciones PROSEGUR	EUR	798	1,53	822	1,58
ES0175438003 - Acciones PROSEGUR	EUR	843	1,62	958	1,84
ES0183746314 - Acciones VIDRALA	EUR	188	0,36	218	0,42
TOTAL RV COTIZADA		5.267	10,11	6.376	12,24
TOTAL RENTA VARIABLE		5.267	10,11	6.376	12,24
ES0108381031 - Acciones PACTIO GESTION	EUR	0	0,00	4	0,01

Descripción de la inversión y emisor	Divisa	Periodo actual		Periodo anterior	
		Valor de mercado	%	Valor de mercado	%
ES0125483034 - Acciones PACTIO GESTION	EUR	0	0,00	4	0,01
TOTAL IIC		0	0,00	8	0,02
TOTAL INVERSIONES FINANCIERAS INTERIOR		8.119	15,59	9.755	18,72
USU0187NAA91 - Bonos ALLIANCE RES 3,750 2023-05-01	USD	814	1,56	775	1,49
CH0200044813 - Bonos ARYZTA AG 1,326 2022-10-25	CHF	1.337	2,57	1.320	2,53
XS1134780557 - Bonos ARYZTA AG 0,000 2023-03-28	EUR	1.359	2,61	1.388	2,66
NO0010893076 - Bonos BROOGE PEROLEUM AND 4,250 2023-09-24	USD	1.458	2,80	1.388	2,66
XS1391063424 - Bonos BURFORD CAPITAL LTD 3,062 2024-10-26	GBP	887	1,70	930	1,79
US21871NAB73 - Bonos CONSUMER CYC SERVICE 4,125 2024-04-15	USD	204	0,39	187	0,36
US25260WAC55 - Bonos DIAMOND OFFSHORE DR 4,500 2023-04-22	USD	43	0,08	44	0,08
NO0011021974 - Bonos DIANA SHIPPING 4,187 2024-06-22	USD	796	1,53	747	1,43
MHY2188B1240 - Bonos DYNAGAS LNG 2,187 2023-11-22	USD	1	0,00	1	0,00
NO0011091290 - Bonos EURONAV LUXEMBOURG S 3,125 2025-09-14	USD	2.143	4,11	1.978	3,80
MHY2687W1241 - Bonos GASLOG LTD 2,050 2060-03-15	USD	287	0,55	0	0,00
NO0011123432 - Bonos GOLAR LNG 3,500 2024-04-20	USD	2.139	4,11	1.983	3,81
XS2076836555 - Bonos GRIFOLS 0,812 2025-02-15	EUR	221	0,43	228	0,44
NO0010782949 - Bonos HOEGH LNG HOLDINGS 1,792 2022-08-01	NOK	0	0,00	387	0,74
NO0012423476 - Bonos INTERNATIONAL PETROL 3,625 2025-02-01	USD	1.224	2,35	1.190	2,28
USU5007TAA35 - Bonos KOSMOS ENERGY 3,562 2023-04-04	USD	1.005	1,93	963	1,85
XS232219612 - Bonos NEINOR HOMES SLU 2,250 2023-04-15	EUR	540	1,04	366	0,70
USU7049LAB46 - Bonos PEABODY ENERGY CORPO 3,187 2023-03-31	USD	285	0,55	321	0,62
US71654QCK67 - Bonos PETROLEOS MEXICANOS 2,675 2028-02-12	USD	144	0,28	140	0,27
NO0011151870 - Bonos TEEKAY CORPORATION 1,850 2026-02-18	NOK	340	0,65	351	0,67
DE000A2TEDB8 - Bonos THYSSEN KRUPP 2,875 2023-11-22	EUR	941	1,81	961	1,84
XS1617531063 - Bonos TURKIYE GARANTI BANK 3,062 2027-05-24	USD	172	0,33	163	0,31
XS2241387500 - Bonos ULKER BISKUVI SANAYI 3,455 2025-10-30	USD	1.019	1,96	1.056	2,03
USU85254AF42 - Bonos W&T OFFSHORE INCI 4,875 2023-11-01	USD	1.262	2,42	1.158	2,22
Total Renta Fija Privada Cotizada mas de 1 año		18.624	35,75	18.027	34,60
US22025YAP51 - Bonos CONSUMER CYC SERVICE 2,312 2023-02-01	USD	405	0,78	950	1,82
NO0010782949 - Bonos HOEGH LNG HOLDINGS 1,792 2023-08-01	NOK	380	0,73	0	0,00
US46032V1061 - Bonos SEAWAYS 2,125 2023-06-30	USD	0	0,00	1.899	3,64
DE000A19WVN8 - Bonos R-LOGITECH 8,500 2023-03-29	EUR	193	0,37	188	0,36
USG9T27HAB07 - Bonos VEDANTA RESOURCES PLC 4,000 2023-04-23	USD	700	1,34	950	1,82
Total Renta Fija Privada Cotizada menos de 1 año		1.679	3,22	3.987	7,65
TOTAL RENTA FIJA COTIZADA		20.303	38,98	22.014	42,25
TOTAL RENTA FIJA		20.303	38,98	22.014	42,25
SE0007897079 - Acciones ACADEMEDIA AB	SEK	0	0,00	0	0,00
US02319V1035 - Acciones AMBEV SA	USD	20	0,04	17	0,03
CH0043238366 - Acciones ARYZTA AG	CHF	22	0,04	22	0,04
CY0106002112 - Acciones ATALAYA MINING PLC	GBP	183	0,35	390	0,75
KYG1611B1077 - Acciones BROOGE PEROLEUM AND GAS	USD	81	0,16	73	0,14
US2044481040 - Acciones CIA DE MINAS BUENAVENTUR ADR	USD	627	1,20	228	0,44
GG00BMGYLN96 - Acciones BURFORD CAPITAL LTD	USD	1.339	2,57	2.091	4,01
CA1348082035 - Acciones CANACOL ENERGY LTD	CAD	147	0,28	199	0,38
US25271C2017 - Acciones DIAMOND OFFSHORE DRILLING	USD	910	1,75	756	1,45
NL0012328801 - Acciones DP EURASIA	GBP	140	0,27	190	0,37
DK0061135753 - Acciones DRILLING	DKK	65	0,12	51	0,10
GB00B7KR2P84 - Acciones EASYJET PLC	GBP	305	0,59	385	0,74
BE0003808251 - Acciones EXMAR NV	EUR	0	0,00	2	0,00
CA3039011026 - Acciones FAIRFAX FIANACIAL	USD	1.308	2,51	1.416	2,72
CA3038971022 - Acciones FAIRFAX FIANACIAL HOLDINGS	USD	1.551	2,98	1.638	3,14
DE0005785604 - Acciones FRESENIUS	EUR	520	1,00	685	1,31
DE0005785802 - Acciones FRESENIUS	EUR	22	0,04	37	0,07
BMG9456A1009 - Acciones GOLAR LNG	USD	24	0,05	21	0,04
MX01HO090008 - Acciones GRUPO HOTELERO SANTA FE	MXN	295	0,57	270	0,52
DK0010256197 - Acciones HARTMANN A/S	DKK	387	0,74	430	0,83
PTIBS0AM0008 - Acciones IBERSOL SGPS	EUR	118	0,23	144	0,28
BE0974293251 - Acciones ANHEUSER-BUSH INBEV	EUR	1.763	3,38	1.937	3,72
CA4969024047 - Acciones KINROSS GOLD CORPORATION	USD	46	0,09	0	0,00
AU000000LCA6 - Acciones LITIGATION CAPITAL MANAG	GBP	34	0,06	45	0,09
GB0008706128 - Acciones LLOYDS TSB GROUP PLC	GBP	1.054	2,02	1.470	2,82
GB00B1GSHX72 - Acciones LSL PROP	GBP	719	1,38	937	1,80
GB00BYWQCY12 - Acciones MANOLETE PARTNERS PLC	GBP	7	0,01	11	0,02
CA46016U1084 - Acciones INTERNATIONAL PETROLEUM CORP	SEK	33	0,06	37	0,07
FR0000131906 - Acciones RENAULT SA	EUR	91	0,18	78	0,15
MHY410531021 - Acciones SEAWAYS	USD	0	0,00	390	0,75
EE3100001751 - Acciones SILVANO	PLN	0	0,00	0	0,00
MHY8564W1030 - Acciones TEEKAY CORPORATION	USD	0	0,00	0	0,00
US9037421040 - Acciones ULKER BISKUVI SANAYI	USD	321	0,62	264	0,51
TREULKR00015 - Acciones ULKER BISKUVI SANAYI	TRY	288	0,55	210	0,40
FR0013447729 - Acciones VERALLIA	EUR	106	0,20	105	0,20
TOTAL RV COTIZADA		12.527	24,05	14.530	27,89
TOTAL RENTA VARIABLE		12.527	24,05	14.530	27,89
TOTAL INVERSIONES FINANCIERAS EXTERIOR		32.830	63,02	36.543	70,14

Descripción de la inversión y emisor	Divisa	Periodo actual		Periodo anterior	
		Valor de mercado	%	Valor de mercado	%
TOTAL INVERSIONES FINANCIERAS		40.949	78,61	46.298	88,87

Notas: El período se refiere al final del trimestre o semestre, según sea el caso.

Los productos estructurados suponen un 0,00% de la cartera de inversiones financieras del fondo o compartimento.

11. Información sobre la política de remuneración

No aplicable

12. Información sobre las operaciones de financiación de valores, reutilización de las garantías y swaps de rendimiento total (Reglamento UE 2015/2365)