

<b>Gestora</b>	360 CORA SGIIC SA	<b>Depositario</b>	UBS EUROPE SE SUC. EN ESPA#A
<b>Grupo Gestora</b>	360 CORA SGIIC SA	<b>Grupo Depositario</b>	GRUPO UBS
<b>Auditor</b>	PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDITORES S.	<b>Rating depositario</b>	n.d.
<b>Fondo por compartimentos</b>	NO		

El presente informe, junto con los últimos informes periódicos, se encuentran disponibles por medios telemáticos en [www.360cora/que-hacemos/gestión](http://www.360cora/que-hacemos/gestión).

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

**Dirección**

C/ Antonio Maura, 7 Bajo Izquierda, 28014 Madrid

**Correo electrónico**                      [sac@360cora.com](mailto:sac@360cora.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](mailto:inversores@cnmv.es)).**

**INFORMACIÓN FONDO**

**Fecha de registro:**                      30/09/2020

**1. Política de inversión y divisa de denominación**
**Categoría**

Tipo de Fondo:                      Fondo que invierte más del 10% en otros fondos y/o sociedades  
Vocación Inversora:                      Global  
Perfil de riesgo:                      Alto

**Descripción general**

Se invertirá entre el 0 y el 100% de la exposición total en renta variable únicamente a través de futuros cotizados en mercados organizados sobre índices de renta variable y el resto de renta pública o privada (incluyendo depósitos e instrumentos del mercado monetario cotizados o no, liquidos). La exposición a riesgo de divisa podrá ser del 0 al 100% de la exposición total. En cuanto a renta fija no existirá predeterminación por tipo de emisor, sectores, duración media de la cartera o calificación crediticia de a emisiones o emisores, pudiendo estar la totalidad de la cartera invertida en activos o emisores de baja calidad crediticia o incluso sin rating. La inversión en renta fija de baja calidad crediticia puede influir negativamente en la liquidez del fondo.

**Operativa en instrumentos derivados**

Inversión y cobertura.

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**
**2.1. 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
	Período Actual	Período Anterior	Período Actual	Período Anterior		Período Actual	Período Anterior		
CODEX GLOBAL	107.864,01	30.000,00	5	1	EUR	0,00	0,00		NO
CODEX GLOBAL	292.669,70	0,00	46	0	EUR	0,00	0,00		NO

**Patrimonio (en miles)**

CLASE	Divisa	A final del período	Diciembre 2019	Diciembre 2018	Diciembre 2017
CODEX GLOBAL	EUR	1.108	0	0	0
CODEX GLOBAL	EUR	3.004	0	0	0

**Valor liquidativo de la participación**

CLASE	Divisa	A final del período	Diciembre 2019	Diciembre 2018	Diciembre 2017
CODEX GLOBAL	EUR	10,2720	0,0000	0,0000	0,0000
CODEX GLOBAL	EUR	10,2631	0,0000	0,0000	0,0000

**Comisiones aplicadas en el período, sobre patrimonio medio**

CLASE	Comisión de gestión						Base de cálculo	Sistema de imputación
	% efectivamente cobrado							
	Período			Acumulada				
	s/patrimonio	s/resultados	Total	s/patrimonio	s/resultados	Total		
CODEX GLOBAL FUND_CLASE I	0,20	0,20	0,40	0,28	0,27	0,55	mixta	al fondo
CODEX GLOBAL FUND_CLASE R	0,30	0,33	0,63	0,30	0,33	0,63	mixta	al fondo

CLASE	Comisión de depositario			Base de cálculo
	% efectivamente cobrado			
	Período	Acumulada		
CODEX GLOBAL FUND_CLASE I	0,02	0,03		patrimonio
CODEX GLOBAL FUND_CLASE R	0,02	0,02		patrimonio

	Período Actual	Período Anterior	Año Actual	Año Anterior
<b>Índice de rotación de la cartera (%)</b>	0,00	0,00	0,00	0,00
<b>Rentabilidad media de la liquidez (% anualizado)</b>	-0,59	-0,08	-0,22	0,00

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, este dato y el de patrimonio se refieren a los últimos disponibles.

**2.2. Comportamiento**

Cuando no exista información disponible las correspondientes celdas aparecerán en blanco

**A) Individual CODEX GLOBAL FUND\_CLASE I Divisa de denominación: EUR**
**Rentabilidad (% sin anualizar)**

	Acumulado 2020	Trimestral				Anual			
		Trimestre Actual	2º Trimestre 2020	1er Trimestre 2020	4º Trimestre 2019	2019	2018	2017	2015
<b>Rentabilidad</b>		2,97							

Rentabilidades extremas(i)	Trimestre Actual		Último año		Últimos 3 años	
	%	Fecha	%	Fecha	%	Fecha
<b>Rentabilidad mínima (%)</b>	-0,89	23/09/2020				
<b>Rentabilidad máxima (%)</b>	1,46	21/09/2020				

(i) Sólo se informa para las clases con una antigüedad mínima del período 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 2020	Trimestral				Anual			
		Trimestre Actual	2º Trimestre 2020	1er Trimestre 2020	4º Trimestre 2019	2019	2018	2017	2015
<b>Volatilidad(ii) de:</b>									
Valor liquidativo		5,04							
Ibex-35	0,00	21,33	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Letra Tesoro 1 año	0,00	0,14	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
<b>VaR histórico(iii)</b>									

(ii) Volatilidad histórica: Indica el riesgo de un valor en un período, 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: 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 período de referencia.

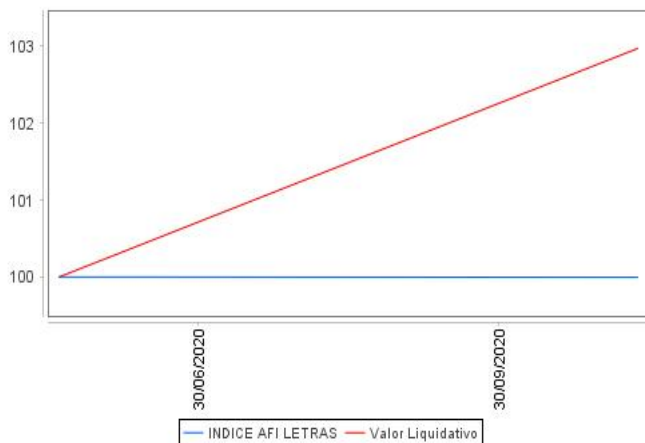
## Gastos (% s/ patrimonio medio)

Acumulado 2020	Trimestral				Anual			
	Trimestre Actual	2º Trimestre 2020	1er Trimestre 2020	4º Trimestre 2019	2019	2018	2017	2015
0,81	0,52	0,24						

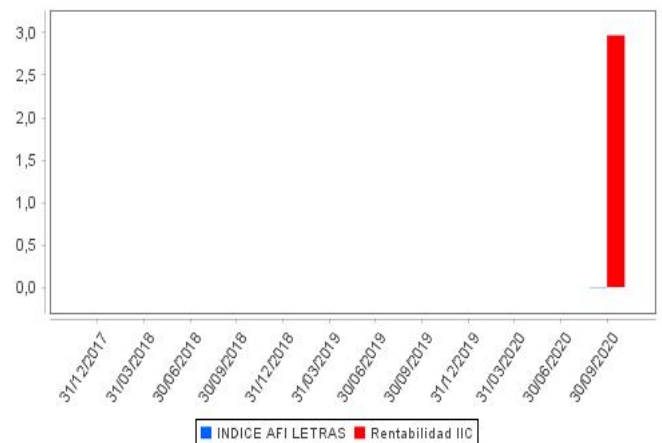
Incluye los gastos directos soportados en el período de referencia: comisión de gestión sobre patrimonio, comisión de depositario, auditoría, servicios bancarios (salvo gastos de financiación), y resto de gastos de gestión corriente, en términos de porcentaje sobre patrimonio medio del período. En el caso de fondos/compartimentos que invierten más de un 10% de su patrimonio en otras IIC se incluyen también los gastos soportados indirectamente, derivados de estas inversiones, que incluyen las comisiones de suscripción y de 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 CODEX GLOBAL FUND\_CLASE R Divisa de denominación: EUR

### Rentabilidad (% sin anualizar)

Rentabilidad	Acumulado 2020	Trimestral				Anual			
		Trimestre Actual	2º Trimestre 2020	1er Trimestre 2020	4º Trimestre 2019	2019	2018	2017	2015

Rentabilidades extremas(i)	Trimestre Actual		Último año		Últimos 3 años	
	%	Fecha	%	Fecha	%	Fecha
Rentabilidad mínima (%)						
Rentabilidad máxima (%)						

(i) Sólo se informa para las clases con una antigüedad mínima del período 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 2020	Trimestral				Anual			
		Trimestre Actual	2° Trimestre 2020	1er Trimestre 2020	4° Trimestre 2019	2019	2018	2017	2015
<b>Volatilidad(ii) de:</b>									
Valor liquidativo									
Ibex-35	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Letra Tesoro 1 año	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
<b>VaR histórico(iii)</b>									

(ii) Volatilidad histórica: Indica el riesgo de un valor en un período, 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: 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 período de referencia.

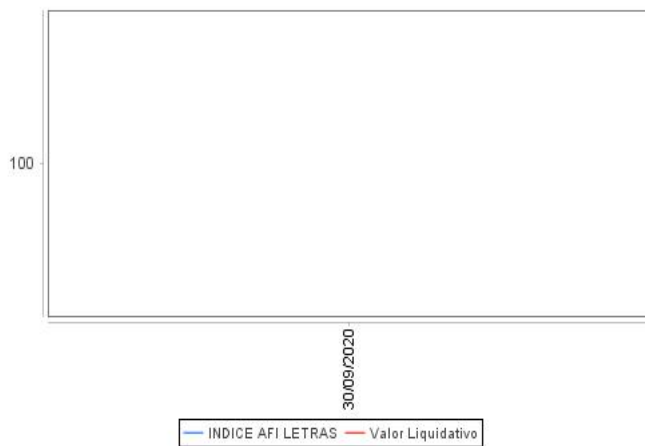
## Gastos (% s/ patrimonio medio)

Acumulado 2020	Trimestral				Anual			
	Trimestre Actual	2° Trimestre 2020	1er Trimestre 2020	4° Trimestre 2019	2019	2018	2017	2015
0,83	0,63							

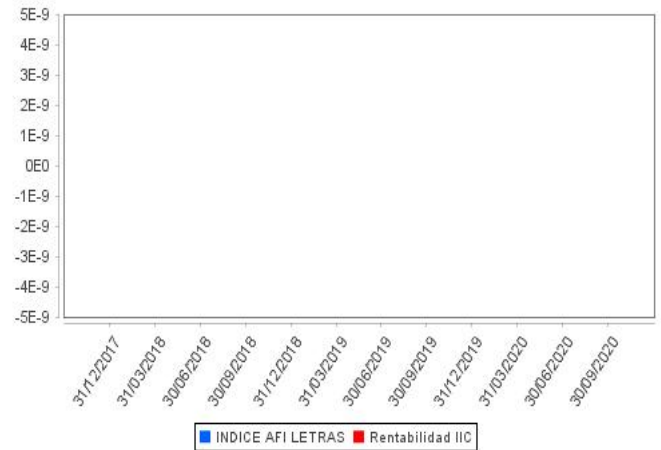
Incluye los gastos directos soportados en el período de referencia: comisión de gestión sobre patrimonio, comisión de depositario, auditoría, servicios bancarios (salvo gastos de financiación), y resto de gastos de gestión corriente, en términos de porcentaje sobre patrimonio medio del período. En el caso de fondos/compartimentos que invierten más de un 10% de su patrimonio en otras IIC se incluyen también los gastos soportados indirectamente, derivados de estas inversiones, que incluyen las comisiones de suscripción y de 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 período de referencia, la rentabilidad media 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**
Monetario			
Renta Fija Euro	0	0	0,00
Renta Fija Internacional	0	0	0,00
Renta Fija Mixta Euro	0	0	0,00
Renta Fija Mixta Internacional	0	0	0,00
Renta Variable Mixta Euro	0	0	0,00
Renta Variable Mixta Internacional	0	0	0,00
Renta Variable Euro	0	0	0,00
Renta Variable Internacional	0	0	0,00
IIC de gestión Pasiva(1)	0	0	0,00
Garantizado de Rendimiento Fijo	0	0	0,00
Garantizado de Rendimiento Variable	0	0	0,00
De Garantía Parcial	0	0	0,00
Retorno Absoluto	0	0	0,00
Global	2.357	24	1,06
FMM a Corto Plazo de Valor Liquidativo Variable	0	0	0,00
FMM a Corto Plazo de Valor Liquidativo Constante de Deuda Publica	0	0	0,00
FMM a Corto Plazo de Valor Liquidativo de Baja Volatilidad	0	0	0,00
Estándar de Valor Liquidativo Variable	0	0	0,00
Renta Fija Euro Corto Plazo	0	0	0,00
IIC que replica un Índice	0	0	0,00
IIC con objetivo concreto de Rentabilidad no Garantizado	0	0	0,00
<b>Total fondos</b>	<b>2.357</b>	<b>24</b>	<b>1,06</b>

\* Medias.

(1): Incluye IIC que replican o reproducen un índice, fondos cotizados (ETF) e IIC con objetivo concreto de rentabilidad no garantizado.

\*\* 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	28	0,68		0,00
* Cartera interior	0	0,00	0	0,00
* Cartera exterior	28	0,68	0	0,00
* Intereses de la cartera de inversión	0	0,00	0	0,00
* Inversiones dudosas, morosas o en litigio	0	0,00	0	0,00
(+) LIQUIDEZ (TESORERÍA)	3.782	91,97	300	100,33
(+/-) RESTO	302	7,34	-1	-0,33
<b>TOTAL PATRIMONIO</b>	<b>4.112</b>	<b>100,00</b>	<b>299</b>	<b>100,00</b>

Notas:

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

Las inversiones financieras se informan a valor estimado de realización.

## 2.4. Estado de variación patrimonial

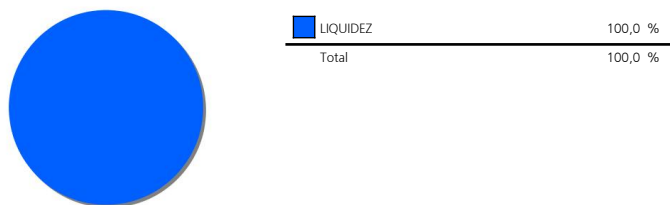
	% sobre patrimonio medio			% variación respecto fin período anterior
	Variación del período actual	Variación del período anterior	Variación acumulada anual	
<b>PATRIMONIO FIN PERIODO ANTERIOR (miles de EUR)</b>	<b>299</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	
+/- Suscripciones/reembolsos (neto)	165,41	100,04	273,59	1.137,66
- Beneficios brutos distribuidos	0,00	0,00	0,00	0,00
+/- Rendimientos netos	4,43	-0,24	6,73	25.020,92
(+) Rendimientos de gestión	5,37	0,00	8,23	0,00
+ Intereses	0,00	0,00	0,00	0,00
+ Dividendos	0,00	0,00	0,00	0,00
+/- Resultados en renta fija (realizadas o no)	0,00	0,00	0,00	0,00
+/- Resultados en renta variable (realizadas o no)	0,00	0,00	0,00	0,00
+/- Resultados en depósitos (realizadas o no)	0,00	0,00	0,00	0,00
+/- Resultados en derivados (realizadas o no)	5,22	0,00	8,00	0,00
+/- Resultados en IIC (realizadas o no)	0,00	0,00	0,00	0,00
+/- Otros resultados	0,15	0,00	0,23	0,00
+/- Otros rendimientos	0,00	0,00	0,00	0,00
(-) Gastos repercutidos	-0,94	-0,24	-1,50	25.020,92
- Comisión de gestión	-0,58	-0,03	-0,89	16.446,24
- Comisión de depositario	-0,02	0,00	-0,03	4.991,56
- Gastos por servicios exteriores	-0,18	-0,04	-0,28	3.133,12
- Otros gastos de gestión corriente	-0,12	-0,17	-0,23	450,00
- Otros gastos repercutidos	-0,04	0,00	-0,07	0,00
(+) Ingresos	0,00	0,00	0,00	0,00
+ 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	0,00	0,00	0,00	0,00
<b>PATRIMONIO FIN PERIODO ACTUAL (miles de EUR)</b>	<b>4.112</b>	<b>299</b>	<b>4.112</b>	

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

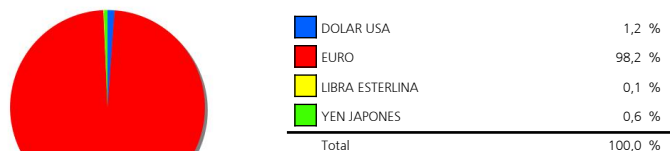
Notas: El período se refiere al trimestre o semestre, según sea el caso.

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

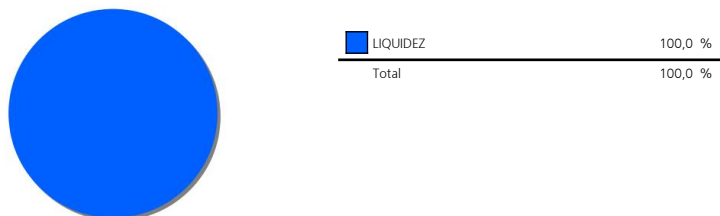
#### Sector Económico



#### Divisas



#### Tipo de Valor



### 3.3. Operativa en derivados. Resumen de las posiciones abiertas al cierre del período (Importes en miles de EUR)

	Instrumento	Importe nominal comprometido	Objetivo de la inversión
DJ EUROSTOXX 50	Venta FuturoIDJ EUROSTOXX 50I10I	1.153	Cobertura
FTSE 100	Venta FuturoIFTSE 100I10I	455	Cobertura
MSCI EMMAS	Compra FuturoIMSCI EMMASI50I	921	Inversión
NIKKEI 225	Venta FuturoINIKKEI 225I1000I	189	Cobertura
SP 500 INDICE	Compra FuturoISP 500 INDICEI50I	855	Inversión
<b>Total subyacente renta variable</b>		<b>3.573</b>	
<b>TOTAL OBLIGACIONES</b>		<b>3.573</b>	

#### 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

No aplica.

#### 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 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

f.) El importe de las adquisiciones de valores o instrumentos financieros cuya contrapartida ha sido una entidad del grupo de la gestora o depositario, u otra IIC gestionada por la misma gestora u otra gestora del grupo es 28.048,07 euros, suponiendo un 0,01% sobre el patrimonio medio de la IIC en el período de referencia. La estimación de costes implícitos de estas operaciones asciende a 16,83 eur.

#### 8. Información y advertencias a instancia de la CNMV

No aplica.

#### 9. Anexo explicativo del informe periódico

##### CODEX GLOBAL FUND FI

#### 1. SITUACION DE LOS MERCADOS Y EVOLUCIÓN DEL FONDO.

##### A) VISIÓN DE LA GESTORA/SOCIEDAD SOBRE LA SITUACIÓN DE LOS MERCADOS.

El tercer trimestre de 2020 ha sido ligeramente negativo para las bolsas europeas con una caída del -1,25% en el Eurostoxx50. El selectivo español Ibex 35 tuvo el peor comportamiento dentro de los principales índices de Europa y perdió un -7,12% en el tercer trimestre del año. En el lado positivo se encuentran los índices americanos, que volvieron a la zona de máximos históricos. Así S&P 500 subió un +8,47% (+4,04% en euros) en el periodo julio-septiembre y el Nasdaq 100 mantuvo su buen comportamiento de los últimos meses y se revalorizó un 11,02% (+6,49% en euros) en el trimestre. Las rentabilidades acumuladas en 2020 a cierre de septiembre de los principales índices son: Eurostoxx50 -14,73%, Ibex 35 -29,77%, S&P500 +4,09% (-0,29% en euros) y Nasdaq 24,46% (+19,23% en euros).

En renta fija corporativa, los diferenciales de crédito continuaron estrechándose, favoreciendo una positiva evolución de los precios de los bonos y una sostenida rentabilidad positiva durante el trimestre en todos sus segmentos. También conviene resaltar que, en el tercer trimestre, el dólar americano se ha depreciado más de un 4% frente al euro. El precio del petróleo Brent ha recuperado cierta tranquilidad y se ha movido en la horquilla 40-47 USD/barril, mientras que el oro ha llegado a tocar máximos plurianuales por encima de los 2.070



USD/onza.

Los datos macroeconómicos conocidos durante el trimestre han mostrado una tendencia moderadamente positiva a nivel global. Tras un muy mal primer semestre, tanto indicadores adelantados como indicadores de actividad vuelven a zona de expansión económica en las principales zonas económicas del mundo. Cierto es que los datos muestran una evolución favorable mes a mes, pero también que el ritmo de recuperación es cada vez más lento. Es notable, y cada vez más, la diferencia entre la evolución de los sectores industriales en comparación con los sectores ligados a servicios. Estos últimos registran un claro peor comportamiento, destacando por el lado negativo todos los sectores relacionados con el turismo (hoteles, aerolíneas) y/o restauración.

Tanto la Reserva Federal como el Banco Central Europeo han continuado con sus medidas de estímulo monetario, y han anunciado largos periodos de tiempo de tipos de interés bajos. El mercado no espera ningún tipo de revisión en los tipos de interés hasta finales de 2022 en EEUU y 2023 en Europa. En ambos lados del Atlántico los presidentes de los bancos emisores han reclamado a los distintos gobiernos que pongan en marcha programas de estímulo fiscal que complementen las medidas monetarias. Europa tomó la iniciativa anunciando un gran programa de gasto de 750.000 millones de euros para combatir la crisis del Covid. En EEUU, demócratas y republicanos siguen negociando un acuerdo que permita poner en marcha un programa de gasto de entre 2 y 3 billones de dólares.

#### **B) DECISIONES GENERALES DE INVERSIÓN ADOPTADAS.**

El nivel de exposición neto (suma de posiciones largas y cortas) de todas las posiciones tomadas siempre ha sido 0% en el trimestre, como previsto en la política de inversión. Cada 15 días, en base a los datos publicados, se modifican las posiciones en futuros para adaptarlas al nuevo escenario. No ha habido inversiones en renta fija. El fondo sólo invertirá en posiciones largas o cortas de futuros de índices.

#### **C) ÍNDICE DE REFERENCIA.**

El fondo no tiene índice de referencia indicado en el folleto.

#### **D) EVOLUCIÓN DEL PATRIMONIO, PARTICIPES, RENTABILIDAD Y GASTOS DE LA IIC.**

El patrimonio del Fondo a cierre del periodo era de 4.111.661,78 EUR con 51 participes. El detalle del patrimonio por clase es el siguiente: la clase I del fondo tiene a fin de septiembre 5 participes con un patrimonio total de 1.107.976,79 EUR, mientras que la clase R tiene 46 participes con un patrimonio de 3.003.684,99 EUR.

El total de gastos soportados por el fondo en lo que va de ejercicio han sido de un 0,81% del patrimonio en la clase I y 0,83% en la R, incluyendo todos los gastos asociados a la constitución y puesta en marcha del fondo, y la comisión variable en base a resultados. No tiene inversiones en otras IICs por lo que los gastos indirectos son 0%.

Durante los pocos días transcurridos en el trimestre, la liquidez de la IIC se ha remunerado al -0.59%

#### **E) RENDIMIENTO DEL FONDO EN COMPARACIÓN CON EL RESTO DE FONDOS DE LA GESTORA.**

N/A

### **2. INFORMACION SOBRE LAS INVERSIONES.**

#### **A) INVERSIONES CONCRETAS REALIZADAS DURANTE EL PERIODO.**

A cierre de trimestre, el fondo presentaba posiciones netas compradoras en los mercados de Estados Unidos y Japón, mediante Futuros sobre el S&P 500 y el Nikkei 225. Por otra parte, los mercados en los que se han tomado posiciones vendedoras a lo largo del trimestre son Zona Euro y Reino Unido, a través de Futuros sobre el Eurostoxx 50 y Ftse 100.

#### **B) OPERATIVA DE PRÉSTAMO DE VALORES.**

N/A

#### **C) OPERATIVA EN DERIVADOS Y ADQUISICIÓN TEMPORAL DE ACTIVOS.**

La operativa en derivados se ha concentrado, tal y como estipula la política de inversión, en posiciones sobre los Futuros del S&P 500, Eurostoxx 50, Nikkei 225, Ftse 100 y MSCI Emerging Markets. El fondo sólo invierte en estos 5 futuros quedando en liquidez la parte no invertida.

#### **D) OTRA INFORMACIÓN SOBRE INVERSIONES.**

A cierre del periodo todo el patrimonio se encuentra en liquidez excepto por la parte depositada como garantías en las Cámaras de Compensación, en torno a un 10% del mismo.

A fecha del informe la IIC no tenía inversiones integradas dentro del artículo 48.1.j del RIIC.

A fecha del informe la IIC no tenía inversiones en productos estructurados.

A fecha del informe la IIC no tenía inversiones dudosas, morosas o en litigio.

### **3. EVOLUCION DEL OBJETIVO CONCRETO DE RENTABILIDAD.**

El fondo ha logrado alcanzar su objetivo de rentabilidad por encima de Euribor, obteniendo en el tercer trimestre un +2,97% en ambas clases del fondo, con un nivel de volatilidad de 5,04%.

### **4. RIESGO ASUMIDO POR LA SOCIEDAD.**

El fondo siempre mantiene riesgo neto a renta variable cercano a 0%, ya que cada vez que se toman nuevas posiciones (cada 15 días) la suma de posiciones de futuros largas es igual a la suma de posiciones cortas. El VaR del Fondo era del -3% a cierre del trimestre. No hay inversiones en renta fija en el fondo.

### **5. EJERCICIO DERECHOS POLITICOS.**

Como entidad gestora, 360 Cora SGIC tiene la firme intención de ejercer los derechos de asistencia y voto en las Juntas Generales de las sociedades españolas que forman parte de las carteras de sus sociedades y fondos de inversión en los siguientes dos supuestos: 1) cuando se haya reconocido una prima de asistencia y 2) cuando sus fondos de inversión tuvieran con más de un año de antigüedad una participación superior al 1% del capital social.

Por las características del fondo, no está prevista la inversión directa en acciones de ninguna compañía por lo que no está previsto el ejercicio de ningún derecho político.

### **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.**

N/A

### **9. COMPARTIMENTOS DE PROPOSITO ESPECIAL (SIDE POCKETS).**

N/A

### **10. PERSPECTIVAS DE MERCADO Y ACTUACION PREVISIBLE DEL FONDO.**

Para los próximos meses, el fondo realizará operaciones cada 15 días sobre futuros de índices en función de los datos macroeconómicos publicados en el periodo. Siempre manteniendo una exposición neta 0% en renta variable y sin inversiones en renta fija. No es posible adelantar las futuras actuaciones del fondo.

### **10. Información sobre la política de remuneración.**

No aplica.

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

No aplica.