

---

PRISM@ SICAV  
(en adelante, “PRISMA SICAV”)

Sociedad de Inversión de Capital Variable  
Luxemburgo

Informe semianual no auditado  
del periodo comprendido entre el 1 de octubre de 2023 y  
el 31 de marzo de 2024

R.C.S. Luxemburgo B-51646

En caso de divergencia con la versión inglesa, prevalecerá la versión inglesa.

No se puede recibir una suscripción basada en este informe anual, incluidos los estados financieros auditados. Las suscripciones solo son válidas si se hacen basándose en el folleto actual acompañado del Documento Datos Fundamentales (“DDF”), el último informe anual, que incluye los estados financieros auditados, y el informe semianual, si se ha publicado posteriormente al informe anual.

---

## Índice

|  |    |
|--|----|
| Dirección y Consejo de Administración        | 3  |
| Información general                          | 4  |
| BALANCE DE SITUACIÓN                         | 5  |
| CAMBIOS EN EL NÚMERO DE ACCIONES             | 7  |
| PRISMA SICAV - Merchbank Global in USD       |    |
| Estado de inversiones y otro patrimonio neto | 8  |
| Desglose de las inversiones                  | 11 |
| PRISMA SICAV - Cube                          |    |
| Estado de inversiones y otro patrimonio neto | 12 |
| Desglose de las inversiones                  | 15 |
| PRISMA SICAV - Prisma 30                     |    |
| Estado de inversiones y otro patrimonio neto | 16 |
| Desglose de las inversiones                  | 18 |
| PRISMA SICAV - Prisma 60                     |    |
| Estado de inversiones y otro patrimonio neto | 19 |
| Desglose de las inversiones                  | 21 |
| PRISMA SICAV - Prisma Global                 |    |
| Estado de inversiones y otro patrimonio neto | 22 |
| Desglose de las inversiones                  | 25 |
| Notas a los estados financieros              | 26 |
| Información no auditada                      | 31 |

## Dirección y Consejo de Administración

### CONSEJO DE ADMINISTRACIÓN DE LA COMPAÑÍA

#### Presidenta

Doña Sylvie Rodrigues  
Consejera independiente, Luxemburgo, Gran Ducado de Luxemburgo

#### Consejeros

Don Donald Villeneuve  
Consejero independiente

Don Nicolas Milerieux  
Consejero independiente, Luxemburgo, Gran Ducado de Luxemburgo

### ADMINISTRACIÓN

#### Domicilio social

11/13, Boulevard de la Foire, L-1528 Luxemburgo, Gran Ducado de Luxemburgo

#### Sociedad Gestora

BIL Manage Invest S.A.  
69, route d'Esch, L-1470 Luxemburgo, Gran Ducado de Luxemburgo

#### Gestor de Inversiones

Prisma Global Asset Management S.G.I.I.C., S.A.  
Tellez 30, Oficinas 2-2, 28007 Madrid, Spain

#### Distribuidor Global

Prisma Global Asset Management S.G.I.I.C., S.A.  
Tellez 30, Oficinas 2-2, 28007 Madrid, Spain

#### Depositario y Agente principal de pagos, Agente de administración central, Agente de registro y transferencias y Agente domiciliario

CACEIS Investor Services Bank S.A.  
14, Porte de France, L-4360 Esch-sur-Alzette, Gran Ducado de Luxemburgo

#### Audidores

Deloitte Audit, *Société à responsabilité limitée*  
20, Boulevard de Kockelscheuer, L-1821 Luxemburgo, Gran Ducado de Luxemburgo

## Información general

La Junta General de Accionistas de PRISM@ SICAV (la “Compañía” o “PRISMA SICAV”) tiene lugar en el domicilio social de la Compañía, o en cualquier otro lugar de Luxemburgo, el último miércoles de enero de cada año a las tres de la tarde o, si ese día no fuera un día laborable en Luxemburgo, el siguiente día laborable en Luxemburgo.

Las notificaciones de las Juntas Generales se envían a los tenedores de las acciones nominativas por correo, al menos ocho días antes de la Junta, a las direcciones que figuran en el registro de accionistas. Las notificaciones incluyen el orden del día y especifican la hora y el lugar de la Junta, así como las condiciones para la admisión, y hacen referencia a los requisitos de la legislación de Luxemburgo con respecto al quórum necesario y a las mayorías necesarias para la Junta.

Los informes anuales, incluidos los estados financieros auditados, se publican dentro de los cuatro meses posteriores al cierre del ejercicio fiscal, y los informes semianuales no auditados se publican dentro de los dos meses posteriores al final del periodo correspondiente. Los informes están disponibles en el domicilio social de la Compañía durante las horas de oficina normales. El ejercicio fiscal de la Compañía empieza el primer día de octubre de cada año y termina el último día de septiembre del año siguiente.

El valor del patrimonio, así como el precio de compra, conversión y venta de acciones de los subfondos son públicos, y están disponibles en el domicilio social de la Compañía.

Con arreglo a la legislación actual, los accionistas no están sujetos a ningún impuesto sobre plusvalías, renta, retención, sucesiones y demás impuestos en Luxemburgo (excepto para los accionistas que tengan en Luxemburgo su domicilio, residencia o establecimiento permanente, o para los accionistas no residentes en Luxemburgo que posean más del 10% de las acciones de la Compañía, y que vendan la totalidad o parte de su tenencia durante los primeros 6 meses desde la fecha de la compra, o, en algunos casos limitados, algunos accionistas que fueron en el pasado residentes en Luxemburgo y que posean más del 10% de las acciones de la Compañía).

Los inversores deberían consultar con sus asesores profesionales acerca de los posibles impuestos y otras consecuencias de haber comprado, mantenido, convertido, transferido o vendido acciones, de acuerdo con las leyes de sus países de nacionalidad, residencia o domicilio.

El detalle de los cambios producidos en la cartera de cada subfondo se encuentra disponible gratuitamente, previa petición, en el domicilio social de la Compañía.

## BALANCE DE SITUACIÓN

### a 31 de marzo de 2024

|  |      | PRISMA<br>SICAV -<br>Merchbanc<br>Global<br>in USD | PRISMA<br>SICAV -<br>Cube | PRISMA<br>SICAV -<br>Prisma 30 | PRISMA<br>SICAV -<br>Prisma 60 | PRISMA<br>SICAV -<br>Prisma Global |
|--|------|--|---------------------------|--------------------------------|--------------------------------|------------------------------------|
|  | Nota | USD  | EUR                       | EUR                            | EUR                            | EUR                                |
| <b>ACTIVO</b>                                  |      |  |                           |                                |                                |                                    |
| Inversiones en títulos al valor de mercado     | (2)  | 8.683.484  | 19.797.327                | 12.431.408                     | 19.628.530                     | 29.738.190                         |
| Contratos de opciones comprados                |      | 718.744  | 1.442.925                 | 0                              | 0                              | 2.444.951                          |
| Liquidez en cuenta corriente                   |      | 712.324  | 490.201                   | 1.008.230                      | 1.825.032                      | 2.350.046                          |
| Importes que recibir por ventas de inversiones |      | 16.212   | 0                         | 36.853                         | 81.849                         | 60.311                             |
| Intereses y dividendos a recibir               |      | 10.334   | 7.143                     | 56.860                         | 71.565                         | 31.993                             |
| Otros activos                                  |      | 4.578  | 4.888                     | 1.565                          | 4.991                          | 3.663                              |
| <b>TOTAL ACTIVO</b>                            |      | <b>10.145.676</b>                                  | <b>21.742.484</b>         | <b>13.534.916</b>              | <b>21.611.967</b>              | <b>34.629.154</b>                  |
| <b>PASIVO</b>                                  |      |  |                           |                                |                                |                                    |
| Margen a pagar al intermediario                | (2)  | 2.667  | 88.538                    | 17.275                         | 47.655                         | 70.155                             |
| Importes a pagar por compras de inversiones    |      | 13.447   | 0                         | 0                              | 0                              | 49.956                             |
| Importes a pagar por reembolsos                |      | 0  | 0                         | 0                              | 1.117                          | 0                                  |
| Pérdida neta latente en contratos de futuros   | (7)  | 0  | 0                         | 78.834                         | 148.932                        | 234.625                            |
| Comisiones de gestión a pagar                  | (3)  | 14.837   | 25.404                    | 16.183                         | 28.883                         | 42.878                             |
| Impuestos y gastos a pagar                     | (6)  | 11.298   | 15.895                    | 10.721                         | 14.402                         | 23.872                             |
| <b>TOTAL PASIVO</b>                            |      | <b>42.249</b>                                      | <b>129.837</b>            | <b>123.013</b>                 | <b>240.989</b>                 | <b>421.486</b>                     |
| <b>TOTAL PATRIMONIO NETO</b>                   |      | <b>10.103.427</b>                                  | <b>21.612.647</b>         | <b>13.411.903</b>              | <b>21.370.978</b>              | <b>34.207.668</b>                  |
| Valor liquidativo por acción                   |      | 36,353   | 313,763                   | 10,357                         | 14,582                         | 20,406                             |
| Número de acciones en curso                    |      | 277.923,513  | 68.882,057                | 1.294.974,171                  | 1.465.606,784                  | 1.676.352,648                      |

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## BALANCE DE SITUACIÓN (continuación) a 31 de marzo de 2024

|  |      | Combinado          |
|--|------|--------------------|
|  | Nota | EUR                |
| <b>ACTIVO</b>                                  |      |                    |
| Inversiones en títulos al valor de mercado     | (2)  | 89.644.288         |
| Contratos de opciones comprados                |      | 4.554.089          |
| Liquidez en cuenta corriente                   |      | 6.333.771          |
| Importes que recibir por ventas de inversiones |      | 194.040            |
| Intereses y dividendos a recibir               |      | 177.140            |
| Otros activos                                  |      | 19.350             |
| <b>TOTAL ACTIVO</b>                            |      | <b>100.922.678</b> |
| <b>PASIVO</b>                                  |      |                    |
| Margen a pagar al intermediario                | (2)  | 226.094            |
| Importes a pagar por compras de inversiones    |      | 62.420             |
| Importes a pagar por reembolsos                |      | 1.117              |
| Pérdida neta latente en contratos de futuros   | (7)  | 462.391            |
| Comisiones de gestión a pagar                  | (3)  | 127.101            |
| Impuestos y gastos a pagar                     | (6)  | 75.362             |
| <b>TOTAL PASIVO</b>                            |      | <b>954.485</b>     |
| <b>TOTAL PATRIMONIO NETO</b>                   |      | <b>99.968.193</b>  |

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## CAMBIOS EN EL NÚMERO DE ACCIONES del periodo finalizado el 31 de marzo de 2024

|   | PRISMA<br>SICAV -<br>Merchbanc Global<br>in USD | PRISMA<br>SICAV -<br>Cube | PRISMA<br>SICAV -<br>Prisma 30 | PRISMA<br>SICAV -<br>Prisma 60 | PRISMA<br>SICAV -<br>Prisma Global |
|---|---|---------------------------|--------------------------------|--------------------------------|------------------------------------|
| Acciones nominativas                                      |   |                           |                                |                                |                                    |
| Número de acciones en circulación al comienzo del periodo | 280.393,695                                     | 68.657,243                | 1.470.866,865                  | 1.541.972,431                  | 1.743.045,714                      |
| Número de acciones emitidas                               | 23.261,761                                      | 680,804                   | 29.826,507                     | 24.687,433                     | 38.891,848                         |
| Número de acciones reembolsadas                           | (25.731,943)                                    | (455,990)                 | (205.719,201)                  | (101.053,080)                  | (105.584,914)                      |
| Número de acciones en circulación al final del periodo    | 277.923,513                                     | 68.882,057                | 1.294.974,171                  | 1.465.606,784                  | 1.676.352,648                      |

## PRISMA SICAV - Merhbanc Global in USD

ESTADO DE INVERSIONES Y OTRO PATRIMONIO NETO  
a 31 de marzo de 2024

(expresado en USD)

| Descripción  | Cant.  | Divisa | Coste          | Valor de mercado | % patrimonio neto |
|--|--------|--------|----------------|------------------|-------------------|
| <b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización oficial o negociados en otro mercado regulado</b> |        |        |                |                  |                   |
| <b>Acciones</b>  |        |        |                |                  |                   |
| <b>Islas Caimán</b>  |        |        |                |                  |                   |
| ALIBABA GROUP HOLDING LTD /ADR   | 4.100  | USD    | 471.931        | 296.676          | 2,94              |
| JD. COM INC /ADR   | 2.969  | USD    | 123.336        | 81.321           | 0,80              |
| NIO INC  | 45.500 | USD    | 348.389        | 204.750          | 2,03              |
|  |        |        | <b>943.656</b> | <b>582.747</b>   | <b>5,77</b>       |
| <b>Francia</b>   |        |        |                |                  |                   |
| L OREAL  | 28     | EUR    | 8.946          | 13.250           | 0,13              |
| SANOFI   | 943    | EUR    | 84.197         | 92.539           | 0,92              |
| VALEO SA   | 6.650  | EUR    | 113.694        | 83.151           | 0,82              |
|  |        |        | <b>206.837</b> | <b>188.940</b>   | <b>1,87</b>       |
| <b>Alemania</b>  |        |        |                |                  |                   |
| BMW-BAYER. MOTORENWERKE  | 579    | EUR    | 40.892         | 66.813           | 0,66              |
|  |        |        | <b>40.892</b>  | <b>66.813</b>    | <b>0,66</b>       |
| <b>Gran Bretaña</b>  |        |        |                |                  |                   |
| RENISHAW PLC   | 3.114  | GBP    | 150.333        | 167.039          | 1,65              |
|  |        |        | <b>150.333</b> | <b>167.039</b>   | <b>1,65</b>       |
| <b>Irlanda</b>   |        |        |                |                  |                   |
| RYANAIR HOLDINGS PLC   | 6.700  | EUR    | 83.819         | 152.011          | 1,50              |
|  |        |        | <b>83.819</b>  | <b>152.011</b>   | <b>1,50</b>       |
| <b>Israel</b>  |        |        |                |                  |                   |
| CHECK POINT SOFTWARE TECHNO  | 664    | USD    | 55.295         | 108.903          | 1,08              |
| INMODE LTD.  | 8.600  | USD    | 230.001        | 185.846          | 1,84              |
|  |        |        | <b>285.296</b> | <b>294.749</b>   | <b>2,92</b>       |
| <b>Japón</b>   |        |        |                |                  |                   |
| CANON INC.   | 2.100  | JPY    | 63.004         | 62.439           | 0,62              |
| FANUC CORP --- SHS   | 5.200  | JPY    | 191.200        | 144.960          | 1,44              |
| HONDA MOTOR CO. LTD  | 2.000  | JPY    | 21.945         | 24.620           | 0,24              |
| TORAY INDUSTRIES INC.  | 5.200  | JPY    | 40.068         | 24.925           | 0,25              |
| TOYOTA MOTOR CORP  | 2.100  | JPY    | 25.212         | 52.798           | 0,52              |
|  |        |        | <b>341.429</b> | <b>309.742</b>   | <b>3,07</b>       |
| <b>España</b>  |        |        |                |                  |                   |
| AMADEUS IT --- SHS -A-   | 1.047  | EUR    | 57.906         | 67.141           | 0,66              |
| LÍNEA DIRECTA BR   | 80.550 | EUR    | 102.630        | 80.384           | 0,80              |
|  |        |        | <b>160.536</b> | <b>147.525</b>   | <b>1,46</b>       |
| <b>Suecia</b>  |        |        |                |                  |                   |
| ASSA ABLOY AB  | 932    | SEK    | 19.510         | 26.739           | 0,27              |
|  |        |        | <b>19.510</b>  | <b>26.739</b>    | <b>0,27</b>       |

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## ESTADO DE INVERSIONES Y OTRO PATRIMONIO NETO (continuación)

### a 31 de marzo de 2024

(expresado en USD)

| Descripción  | Cant.  | Divisa | Coste            | Valor de mercado | % patrimonio neto |
|--|--------|--------|------------------|------------------|-------------------|
| <b>Suiza</b>   |        |        |                  |                  |                   |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT NAM-AK  | 580    | CHF    | 40.890           | 88.429           | 0,87              |
| GARMIN   | 804    | USD    | 69.045           | 119.691          | 1,18              |
| NESTLE /ACT NOM  | 302    | CHF    | 34.225           | 32.064           | 0,32              |
| ROCHE HOLDING AG /GENUSSSCHEIN   | 760    | CHF    | 226.755          | 193.571          | 1,92              |
|  |        |        | <b>370.915</b>   | <b>433.755</b>   | <b>4,29</b>       |
| <b>Taiwán</b>  |        |        |                  |                  |                   |
| TAIWAN SEMICONDUCT.MANUF/SADR  | 1.889  | USD    | 198.098          | 256.999          | 2,54              |
|  |        |        | <b>198.098</b>   | <b>256.999</b>   | <b>2,54</b>       |
| <b>Países Bajos</b>  |        |        |                  |                  |                   |
| ADYEN B.V.144A   | 72     | EUR    | 76.197           | 121.798          | 1,21              |
| ASML HOLDING NV  | 165    | EUR    | 84.107           | 158.821          | 1,57              |
|  |        |        | <b>160.304</b>   | <b>280.619</b>   | <b>2,78</b>       |
| <b>Estados Unidos de América</b>   |        |        |                  |                  |                   |
| 3M CO  | 350    | USD    | 33.916           | 37.125           | 0,37              |
| AIRBNB RG-A  | 840    | USD    | 97.855           | 138.566          | 1,37              |
| ALBEMARLE CORP   | 410    | USD    | 68.895           | 54.013           | 0,54              |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC  | 1.810  | USD    | 275.057          | 270.504          | 2,68              |
| ALPHABET INC -C-   | 1.290  | USD    | 142.561          | 196.415          | 1,94              |
| ARCUS BIOSCIENCES INC  | 8.850  | USD    | 169.557          | 167.088          | 1,65              |
| BANK OF AMERICA CORP   | 12.840 | USD    | 372.256          | 486.893          | 4,82              |
| BIOGEN INC   | 1.552  | USD    | 502.036          | 334.658          | 3,31              |
| BRISTOL MYERS SQUIBB CO  | 764    | USD    | 34.710           | 41.432           | 0,41              |
| CHARLES SCHWAB CORP  | 608    | USD    | 33.576           | 43.983           | 0,44              |
| CITIGROUP INC  | 3.050  | USD    | 140.396          | 192.882          | 1,91              |
| COGNEX CORP  | 5.128  | USD    | 285.453          | 217.530          | 2,15              |
| CORNING INC.   | 6.928  | USD    | 161.620          | 228.347          | 2,26              |
| CUMMINS INC  | 520    | USD    | 93.677           | 153.218          | 1,52              |
| DOCUSIGN INC   | 1.950  | USD    | 229.917          | 116.123          | 1,15              |
| ENPHASE ENERGY INC SHS   | 1.100  | USD    | 187.869          | 133.078          | 1,32              |
| GILEAD SCIENCES INC.   | 5.850  | USD    | 421.647          | 428.512          | 4,24              |
| INCYTE CORPORATION   | 3.740  | USD    | 295.175          | 213.068          | 2,11              |
| INTUITIVE SURGICAL INC   | 650    | USD    | 120.643          | 259.408          | 2,57              |
| JPMORGAN CHASE & CO  | 790    | USD    | 67.285           | 158.237          | 1,57              |
| MICRON TECHNOLOGY INC  | 1.400  | USD    | 81.532           | 165.046          | 1,63              |
| MORGAN STANLEY   | 2.080  | USD    | 89.707           | 195.853          | 1,94              |
| PALANTIR TCHNL-A RG  | 4.100  | USD    | 30.742           | 94.341           | 0,93              |
| QUALCOMM INC.  | 2.810  | USD    | 392.606          | 475.733          | 4,71              |
| QUANTUMSCAPE CORP A  | 5.700  | USD    | 42.985           | 35.853           | 0,36              |
| SAGE THERAPEUTICS INC  | 7.300  | USD    | 261.152          | 136.802          | 1,35              |
| TAPESTRY INC   | 6.450  | USD    | 166.577          | 306.246          | 3,03              |
| TELADOC HEALTH INC   | 5.624  | USD    | 340.630          | 84.922           | 0,84              |
| TESLA INC  | 610    | USD    | 109.948          | 107.232          | 1,06              |
| TWILIO INC -A-   | 531    | USD    | 122.954          | 32.471           | 0,32              |
| VICTORIAS SC RG-WI   | 12.100 | USD    | 402.129          | 234.498          | 2,32              |
| WALT DISNEY  | 292    | USD    | 36.921           | 35.729           | 0,35              |
|  |        |        | <b>5.811.984</b> | <b>5.775.806</b> | <b>57,17</b>      |
| <b>Total - Acciones</b>  |        |        | <b>8.773.609</b> | <b>8.683.484</b> | <b>85,95</b>      |
| <b>Total - Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización oficial o negociados en otro mercado regulado</b> |        |        | <b>8.773.609</b> | <b>8.683.484</b> | <b>85,95</b>      |

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## PRISMA SICAV - Merchbank Global in USD

ESTADO DE INVERSIONES Y OTRO PATRIMONIO NETO (continuación)  
a 31 de marzo de 2024

(expresado en USD)

## Contratos de opciones

| Tipo                                 | Fecha de vencimiento | Precio de ejercicio | Denominación                        | Cant. | Divisa | Coste            | Valor de mercado | % patrimonio neto |
|--------------------------------------|----------------------|---------------------|-------------------------------------|-------|--------|------------------|------------------|-------------------|
| CALL                                 | 19/04/2024           | 110                 | CALL ALBEMARLE CORP                 | 18    | USD    | 35.810           | 39.510           | 0,39              |
| CALL                                 | 17/05/2024           | 70                  | CALL ALIBABA GROUP HOLDING LTD /ADR | 37    | USD    | 18.201           | 18.500           | 0,18              |
| CALL                                 | 19/04/2024           | 70                  | CALL ALIBABA GROUP HOLDING LTD /ADR | 93    | USD    | 59.620           | 31.155           | 0,31              |
| CALL                                 | 19/04/2024           | 15                  | CALL ARCUS BIOSCIENCES INC          | 162   | USD    | 74.034           | 35.640           | 0,35              |
| CALL                                 | 19/04/2024           | 90                  | CALL BAIDU INC -A-/ADR              | 42    | USD    | 64.644           | 64.680           | 0,64              |
| CALL                                 | 19/04/2024           | 210                 | CALL BIOGEN INC                     | 25    | USD    | 42.800           | 19.750           | 0,20              |
| CALL                                 | 17/05/2024           | 200                 | CALL BIOGEN INC                     | 13    | USD    | 28.360           | 23.790           | 0,24              |
| CALL                                 | 19/04/2024           | 60                  | CALL CRISPR THERAPEUTICS LTD        | 48    | USD    | 66.672           | 36.480           | 0,36              |
| CALL                                 | 19/04/2024           | 50                  | CALL DOCUSIGN INC                   | 83    | USD    | 54.076           | 76.775           | 0,76              |
| CALL                                 | 19/04/2024           | 110                 | CALL ENPHASE ENERGY INC SHS         | 37    | USD    | 36.531           | 49.950           | 0,49              |
| CALL                                 | 19/04/2024           | 20                  | CALL INMODE LTD.                    | 168   | USD    | 37.333           | 30.240           | 0,30              |
| CALL                                 | 19/04/2024           | 24                  | CALL JD.COM INC /ADR                | 127   | USD    | 50.165           | 42.545           | 0,42              |
| CALL                                 | 17/05/2024           | 25                  | CALL JD.COM INC /ADR                | 12    | USD    | 3.624            | 3.444            | 0,03              |
| CALL                                 | 17/05/2024           | 4                   | CALL NIO INC                        | 1.200 | USD    | 163.050          | 91.200           | 0,90              |
| CALL                                 | 16/08/2024           | 5                   | CALL QUANTUMSCAPE CORP A            | 130   | USD    | 25.350           | 23.010           | 0,23              |
| CALL                                 | 17/05/2024           | 5                   | CALL QUANTUMSCAPE CORP A            | 115   | USD    | 18.515           | 17.135           | 0,17              |
| CALL                                 | 17/05/2024           | 18                  | CALL SAGE THERAPEUTICS INC          | 89    | USD    | 29.024           | 24.475           | 0,24              |
| CALL                                 | 19/04/2024           | 18                  | CALL SAGE THERAPEUTICS INC          | 44    | USD    | 14.960           | 6.600            | 0,07              |
| CALL                                 | 17/05/2024           | 125                 | CALL TAIWAN SEMICONDUCT.MANUF/SADR  | 29    | USD    | 38.744           | 41.905           | 0,41              |
| CALL                                 | 19/04/2024           | 15                  | CALL TELADOC HEALTH INC             | 190   | USD    | 27.500           | 11.780           | 0,12              |
| CALL                                 | 19/04/2024           | 360                 | CALL VERTEX PHARMACEUTICALS         | 1     | USD    | 6.400            | 5.540            | 0,06              |
| CALL                                 | 19/04/2024           | 15                  | CALL VICTORIAS SC RG-WI             | 56    | USD    | 21.136           | 24.640           | 0,24              |
| <b>Total - Contratos de opciones</b> |                      |                     |                                     |       |        | <b>916.549</b>   | <b>718.744</b>   | <b>7,11</b>       |
| <b>TOTAL CARTERA DE INVERSIÓN</b>    |                      |                     |                                     |       |        | <b>9.690.158</b> | <b>9.402.228</b> | <b>93,06</b>      |

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## DESGLOSE DE INVERSIONES a 31 de marzo de 2024

(expresado como porcentaje del patrimonio neto)

| <b>Área geográfica</b>    | <b>%</b>     | <b>Sector económico</b>                  | <b>%</b>     |
|---------------------------|--------------|--|--------------|
| Estados Unidos de América | 60,73        | Productos farmacéuticos y cosméticos     | 16,88        |
| Islas Caimán              | 8,25         | Software de Internet                     | 10,91        |
| Suiza                     | 4,65         | Semiconductores electrónicos             | 10,57        |
| Israel                    | 3,22         | Bancos e instituciones financieras       | 9,51         |
| Japón                     | 3,07         | Biotecnología                            | 8,07         |
| Taiwán                    | 2,95         | Transmisión de noticias                  | 6,97         |
| Países Bajos              | 2,78         | Industria del automóvil                  | 6,23         |
| Francia                   | 1,87         | Textil                                   | 5,59         |
| Gran Bretaña              | 1,65         | Sociedades de cartera y financieras      | 5,57         |
| Irlanda                   | 1,50         | Otros servicios                          | 2,24         |
| España                    | 1,46         | Servicios públicos                       | 1,81         |
| Alemania                  | 0,66         | Mecánica, maquinaria                     | 1,79         |
| Suecia                    | 0,27         | Transporte                               | 1,50         |
|                           | <b>93,06</b> | Electrónica y equipos eléctricos         | 1,44         |
|                           |              | Productos químicos                       | 1,18         |
|                           |              | Educación sanitaria y servicios sociales | 0,96         |
|                           |              | Seguros                                  | 0,80         |
|                           |              | Bienes de consumo                        | 0,37         |
|                           |              | Artes gráficas, edición                  | 0,35         |
|                           |              | Alimentación y destilerías               | 0,32         |
|                           |              |  | <b>93,06</b> |

## ESTADO DE INVERSIONES Y OTRO PATRIMONIO NETO a 31 de marzo de 2024

(expresado en EUR)

| Descripción  | Cant.   | Divisa | Coste            | Valor de mercado | % patrimonio neto |
|--|---------|--------|------------------|------------------|-------------------|
| <b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización oficial o negociados en otro mercado regulado</b> |         |        |                  |                  |                   |
| <b>Acciones</b>  |         |        |                  |                  |                   |
| <b>Bélgica</b>   |         |        |                  |                  |                   |
| GALAPAGOS NV /SADR   | 3.000   | USD    | 326.325          | 89.540           | 0,41              |
|  |         |        | <b>326.325</b>   | <b>89.540</b>    | <b>0,41</b>       |
| <b>Islas Caimán</b>  |         |        |                  |                  |                   |
| ALIBABA GROUP HOLDING LTD /ADR   | 11.000  | USD    | 1.160.387        | 737.786          | 3,41              |
| BAIDU INC. -A- /ADR  | 5.000   | USD    | 680.264          | 487.927          | 2,26              |
| NIO INC  | 10.000  | USD    | 92.590           | 41.711           | 0,19              |
| TENCENT HLDG /ADR  | 10.000  | USD    | 391.382          | 361.774          | 1,68              |
| WEIBO CORP /SADR -A-   | 100.000 | USD    | 2.395.499        | 842.564          | 3,90              |
|  |         |        | <b>4.720.122</b> | <b>2.471.762</b> | <b>11,44</b>      |
| <b>China</b>   |         |        |                  |                  |                   |
| BYD CO -H-/ADR   | 5.000   | USD    | 233.470          | 235.297          | 1,09              |
|  |         |        | <b>233.470</b>   | <b>235.297</b>   | <b>1,09</b>       |
| <b>Francia</b>   |         |        |                  |                  |                   |
| CELLECTIS SA /SADR   | 30.000  | USD    | 242.583          | 73.690           | 0,34              |
|  |         |        | <b>242.583</b>   | <b>73.690</b>    | <b>0,34</b>       |
| <b>Alemania</b>  |         |        |                  |                  |                   |
| BIONTECH SE /ADR   | 2.000   | USD    | 251.637          | 171.015          | 0,79              |
|  |         |        | <b>251.637</b>   | <b>171.015</b>   | <b>0,79</b>       |
| <b>Israel</b>  |         |        |                  |                  |                   |
| INMODE LTD.  | 10.000  | USD    | 132.389          | 200.306          | 0,93              |
|  |         |        | <b>132.389</b>   | <b>200.306</b>   | <b>0,93</b>       |
| <b>España</b>  |         |        |                  |                  |                   |
| ALMIRALL   | 10.000  | EUR    | 80.706           | 82.650           | 0,38              |
| AMADEUS IT --- SHS -A-   | 2.000   | EUR    | 108.841          | 118.880          | 0,55              |
| INDITEX  | 5.000   | EUR    | 187.122          | 233.350          | 1,08              |
| PHARMA MAR BR  | 3.000   | EUR    | 234.270          | 86.220           | 0,40              |
|  |         |        | <b>610.939</b>   | <b>521.100</b>   | <b>2,41</b>       |
| <b>Suiza</b>   |         |        |                  |                  |                   |
| CRISPR THERAPEUTICS LTD  | 800     | USD    | 82.083           | 50.543           | 0,23              |
| LOGITECH INTERNATIONAL SA  | 5.000   | USD    | 329.656          | 414.191          | 1,92              |
|  |         |        | <b>411.739</b>   | <b>464.734</b>   | <b>2,15</b>       |
| <b>Taiwán</b>  |         |        |                  |                  |                   |
| TAIWAN SEMICONDUCT.MANUF/SADR  | 3.000   | USD    | 283.940          | 378.319          | 1,75              |
|  |         |        | <b>283.940</b>   | <b>378.319</b>   | <b>1,75</b>       |
| <b>Países Bajos</b>  |         |        |                  |                  |                   |
| ADYEN B.V.144A   | 140     | EUR    | 160.094          | 219.520          | 1,02              |
|  |         |        | <b>160.094</b>   | <b>219.520</b>   | <b>1,02</b>       |

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## ESTADO DE INVERSIONES Y OTRO PATRIMONIO NETO (continuación)

### a 31 de marzo de 2024

(expresado en EUR)

| Descripción  | Cant.  | Divisa | Coste             | Valor de mercado  | % patrimonio neto |
|--|--------|--------|-------------------|-------------------|-------------------|
| <b>Estados Unidos de América</b>   |        |        |                   |                   |                   |
| 2SEVENTY BIO RG-WI   | 2.000  | USD    | 217.966           | 9.918             | 0,05              |
| ADVANCED MICRO DEVICES INC   | 3.000  | USD    | 243.581           | 501.896           | 2,32              |
| AIRBNB RG-A  | 2.000  | USD    | 191.500           | 305.807           | 1,42              |
| ALBEMARLE CORP   | 2.000  | USD    | 476.837           | 244.223           | 1,13              |
| ALLIANCE BERNSTEIN HLDG /PRTSHP  | 10.000 | USD    | 179.614           | 322.010           | 1,49              |
| ALLOGENE THERAPEUTICS COMMON   | 4.000  | USD    | 89.193            | 16.573            | 0,08              |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC  | 3.500  | USD    | 319.221           | 484.845           | 2,24              |
| APPLIED OPTOELECTRONICS INC.   | 13.750 | USD    | 582.570           | 176.646           | 0,82              |
| ARCUS BIOSCIENCES INC  | 5.000  | USD    | 148.610           | 87.501            | 0,41              |
| BANK OF AMERICA CORP   | 20.000 | USD    | 378.262           | 702.971           | 3,25              |
| BIOGEN INC   | 8.000  | USD    | 1.726.442         | 1.598.962         | 7,40              |
| BLUEBIRD BIO INC.  | 70.000 | USD    | 494.050           | 83.051            | 0,38              |
| BRISTOL MYERS SQUIBB CO  | 6.000  | USD    | 247.946           | 301.599           | 1,40              |
| CHARLES SCHWAB CORP  | 10.000 | USD    | 312.805           | 670.529           | 3,10              |
| CITIGROUP INC  | 9.000  | USD    | 492.929           | 527.562           | 2,44              |
| COGNEX CORP  | 7.000  | USD    | 329.690           | 275.237           | 1,27              |
| CORNING INC.   | 10.000 | USD    | 125.666           | 305.510           | 1,41              |
| DOCUSIGN INC   | 2.000  | USD    | 229.261           | 110.395           | 0,51              |
| EDITAS MEDICINE INC  | 2.000  | USD    | 75.411            | 13.755            | 0,06              |
| ENPHASE ENERGY INC SHS   | 2.000  | USD    | 238.657           | 224.276           | 1,04              |
| FORTINET   | 2.000  | USD    | 94.573            | 126.635           | 0,59              |
| GENERAL HLDG   | 2.000  | USD    | 399.522           | 233.842           | 1,08              |
| INCYTE CORPORATION   | 22.000 | USD    | 1.431.197         | 1.161.737         | 5,38              |
| INTEL CORP.  | 20.000 | USD    | 784.203           | 818.835           | 3,79              |
| INTELLIA THERAPEUTICS INC  | 1.500  | USD    | 165.539           | 38.249            | 0,18              |
| IPG PHOTONICS CORP.  | 1.000  | USD    | 180.326           | 84.062            | 0,39              |
| LAZARD RG  | 12.500 | USD    | 401.528           | 485.123           | 2,24              |
| MICRON TECHNOLOGY INC  | 8.000  | USD    | 409.680           | 874.190           | 4,04              |
| MODERNA INC  | 3.000  | USD    | 530.011           | 296.315           | 1,37              |
| PALANTIR TCHNL-A RG  | 30.000 | USD    | 535.767           | 639.848           | 2,96              |
| PAYPAL HOLDINGS INC.   | 10.000 | USD    | 1.149.163         | 620.939           | 2,87              |
| PUMA BIOTECH   | 3.500  | USD    | 173.600           | 17.194            | 0,08              |
| QUALCOMM INC.  | 7.500  | USD    | 613.291           | 1.176.948         | 5,45              |
| QUANTUMSCAPE CORP A  | 15.000 | USD    | 194.670           | 87.454            | 0,40              |
| SAGE THERAPEUTICS INC  | 5.000  | USD    | 160.931           | 86.852            | 0,40              |
| TAPESTRY INC   | 5.000  | USD    | 172.139           | 220.049           | 1,02              |
| TELADOC HEALTH INC   | 4.000  | USD    | 463.886           | 55.986            | 0,26              |
| VEEVA SYSTEMS INC.   | 3.000  | USD    | 150.423           | 644.269           | 2,98              |
| WALT DISNEY  | 3.000  | USD    | 300.796           | 340.251           | 1,57              |
|  |        |        | <b>15.411.456</b> | <b>14.972.044</b> | <b>69,27</b>      |
| <b>Total - Acciones</b>  |        |        | <b>22.784.694</b> | <b>19.797.327</b> | <b>91,60</b>      |
| <b>Total - Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización oficial o negociados en otro mercado regulado</b> |        |        | <b>22.784.694</b> | <b>19.797.327</b> | <b>91,60</b>      |

## PRISMA SICAV - Cube

ESTADO DE INVERSIONES Y OTRO PATRIMONIO NETO (continuación)  
a 31 de marzo de 2024

(expresado en EUR)

Contratos de  
opciones

| Tipo                                 | Fecha de vencimiento | Precio de ejercicio | Denominación                        | Cant . | Divisa | Coste             | Valor de mercado  | % patrimonio neto |
|--------------------------------------|----------------------|---------------------|-------------------------------------|--------|--------|-------------------|-------------------|-------------------|
| CALL                                 | 19/04/2024           | 100                 | CALL ALBEMARLE CORP                 | 60     | USD    | 181.196           | 172.128           | 0,80              |
| CALL                                 | 19/04/2024           | 65                  | CALL ALIBABA GROUP HOLDING LTD /ADR | 100    | USD    | 87.056            | 68.128            | 0,31              |
| CALL                                 | 17/05/2024           | 65                  | CALL ALIBABA GROUP HOLDING LTD /ADR | 100    | USD    | 68.806            | 79.251            | 0,37              |
| CALL                                 | 19/04/2024           | 120                 | CALL ALPHABET INC -C-               | 60     | USD    | 111.029           | 169.069           | 0,78              |
| CALL                                 | 19/04/2024           | 90                  | CALL BAIDU INC -A-/ADR              | 30     | USD    | 63.506            | 42.823            | 0,20              |
| CALL                                 | 19/04/2024           | 45                  | CALL DOCUSIGN INC                   | 100    | USD    | 111.924           | 115.864           | 0,54              |
| CALL                                 | 19/04/2024           | 90                  | CALL ENPHASE ENERGY INC SHS         | 60     | USD    | 116.755           | 167.678           | 0,78              |
| CALL                                 | 19/04/2024           | 70                  | CALL GILEAD SCIENCES INC.           | 200    | USD    | 113.674           | 55.615            | 0,26              |
| CALL                                 | 19/04/2024           | 22                  | CALL JD.COM INC /ADR                | 440    | USD    | 146.135           | 218.195           | 1,01              |
| CALL                                 | 19/04/2024           | 120                 | CALL NOVO-NORDISK /ADR-B-           | 20     | USD    | 28.775            | 15.387            | 0,07              |
| CALL                                 | 17/05/2024           | 110                 | CALL NOVO-NORDISK /ADR-B-           | 20     | USD    | 39.431            | 35.223            | 0,16              |
| CALL                                 | 17/05/2024           | 800                 | CALL NVIDIA CORP.                   | 10     | USD    | 128.266           | 116.791           | 0,54              |
| CALL                                 | 17/05/2024           | 130                 | CALL SNOWFLAKE RG-A                 | 20     | USD    | 54.690            | 59.508            | 0,27              |
| CALL                                 | 17/05/2024           | 140                 | CALL SNOWFLAKE RG-A                 | 20     | USD    | 51.147            | 45.419            | 0,21              |
| CALL                                 | 17/05/2024           | 160                 | CALL ZSCALER INC                    | 10     | USD    | 35.273            | 31.515            | 0,14              |
| CALL                                 | 19/04/2024           | 175                 | CALL ZSCALER INC                    | 30     | USD    | 118.726           | 50.331            | 0,24              |
| <b>Total - Contratos de opciones</b> |                      |                     |                                     |        |        | <b>1.456.389</b>  | <b>1.442.925</b>  | <b>6,68</b>       |
| <b>TOTAL CARTERA DE INVERSIÓN</b>    |                      |                     |                                     |        |        | <b>24.241.083</b> | <b>21.240.252</b> | <b>98,28</b>      |

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## PRISMA SICAV - Cube

DESGLOSE DE INVERSIONES  
a 31 de marzo de 2024

(expresado como porcentaje del patrimonio neto)

| <u>Área geográfica</u>    | <u>%</u>     | <u>Sector económico</u>                  | <u>%</u>     |
|---------------------------|--------------|--|--------------|
| Estados Unidos de América | 73,83        | Software de Internet                     | 21,90        |
| Islas Caimán              | 13,33        | Semiconductores electrónicos             | 15,19        |
| España                    | 2,41         | Productos farmacéuticos y cosméticos     | 14,57        |
| Suiza                     | 2,15         | Biotecnología                            | 8,83         |
| Taiwán                    | 1,75         | Sociedades de cartera y financieras      | 7,23         |
| China                     | 1,09         | Transmisión de noticias                  | 6,86         |
| Países Bajos              | 1,02         | Bancos e instituciones financieras       | 6,71         |
| Israel                    | 0,93         | Otros servicios                          | 4,29         |
| Alemania                  | 0,79         | Comercio minorista                       | 2,09         |
| Bélgica                   | 0,41         | Productos químicos                       | 1,93         |
| Francia                   | 0,34         | Equipos de oficina, ordenadores          | 1,92         |
| Dinamarca                 | 0,23         | Electrónica y equipos eléctricos         | 1,90         |
|                           | <b>98,28</b> | Servicios públicos                       | 1,82         |
|                           |              | Artes gráficas, edición                  | 1,57         |
|                           |              | Textil                                   | 1,02         |
|                           |              | Educación sanitaria y servicios sociales | 0,26         |
|                           |              | Industria del automóvil                  | 0,19         |
|                           |              |  | <b>98,28</b> |

## PRISMA SICAV - Prisma 30

ESTADO DE INVERSIONES Y OTRO PATRIMONIO NETO  
a 31 de marzo de 2024

(expresado en EUR)

| Descripción  | Cant.   | Divisa | Coste            | Valor de mercado | % patrimonio neto |
|--|---------|--------|------------------|------------------|-------------------|
| <b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización oficial o negociados en otro mercado regulado</b> |         |        |                  |                  |                   |
| <b>Bonos</b>   |         |        |                  |                  |                   |
| <b>Francia</b>   |         |        |                  |                  |                   |
| AIR LIQUIDE 1,0% 20-02.04.25   | 400.000 | EUR    | 397.880          | 389.496          | 2,90              |
| LVMH 0,75% 20-07.04.25   | 300.000 | EUR    | 295.020          | 291.990          | 2,18              |
|  |         |        | <b>692.900</b>   | <b>681.486</b>   | <b>5,08</b>       |
| <b>Alemania</b>  |         |        |                  |                  |                   |
| GERMANY 0.5% 15-15.02.25   | 710.000 | EUR    | 689.339          | 692.705          | 5,16              |
| GERMANY 1.5% 14-15.05.24   | 700.000 | EUR    | 712.005          | 698.117          | 5,21              |
|  |         |        | <b>1.401.344</b> | <b>1.390.822</b> | <b>10,37</b>      |
| <b>España</b>  |         |        |                  |                  |                   |
| SPANISH GOV 2.75% 14-31.10.24  | 600.000 | EUR    | 594.390          | 596.604          | 4,45              |
|  |         |        | <b>594.390</b>   | <b>596.604</b>   | <b>4,45</b>       |
| <b>Países Bajos</b>  |         |        |                  |                  |                   |
| ASML HLDG 1.375% 16-07.07.26   | 300.000 | EUR    | 282.750          | 287.937          | 2,14              |
| ING GROUP 0,1% 19-03.09.25   | 500.000 | EUR    | 474.750          | 491.895          | 3,67              |
|  |         |        | <b>757.500</b>   | <b>779.832</b>   | <b>5,81</b>       |
| <b>Estados Unidos de América</b>   |         |        |                  |                  |                   |
| BERKSHIRE 0,0% 20-12.03.25   | 430.000 | EUR    | 405.490          | 415.625          | 3,10              |
| BOOKING HLD 0,10% 21-08.03.25  | 460.000 | EUR    | 443.440          | 444.884          | 3,32              |
| CORNING 3.875% 23-15.05.26   | 150.000 | EUR    | 148.500          | 150.203          | 1,12              |
| USA 0.75% 21-15.11.24 /TBO   | 350.000 | USD    | 326.784          | 315.574          | 2,36              |
| USA 2% 17-30.04.24 /TBO  | 350.000 | USD    | 327.013          | 323.456          | 2,41              |
| USA 2.125% 17-30.09.24 /TBO  | 550.000 | USD    | 535.119          | 501.996          | 3,74              |
| USA 2.625% 18-31.03.25 /TBO  | 360.000 | USD    | 308.481          | 325.972          | 2,43              |
| USA 4.0% 22-15.12.25 /TBO  | 400.000 | USD    | 365.668          | 366.218          | 2,73              |
| XILINX 2,95% 17-01.06.24   | 390.000 | USD    | 367.833          | 359.746          | 2,68              |
|  |         |        | <b>3.228.328</b> | <b>3.203.674</b> | <b>23,89</b>      |
| <b>Total - Bonos</b>   |         |        | <b>6.674.462</b> | <b>6.652.418</b> | <b>49,60</b>      |
| <b>Acciones</b>  |         |        |                  |                  |                   |
| <b>Islas Caimán</b>  |         |        |                  |                  |                   |
| ALIBABA GROUP HOLDING LTD /ADR   | 4.500   | USD    | 387.334          | 301.821          | 2,25              |
|  |         |        | <b>387.334</b>   | <b>301.821</b>   | <b>2,25</b>       |
| <b>Francia</b>   |         |        |                  |                  |                   |
| AIR LIQUIDE  | 500     | EUR    | 56.219           | 96.420           | 0,72              |
| AXA  | 3.000   | EUR    | 54.314           | 104.445          | 0,78              |
| L OREAL  | 176     | EUR    | 56.693           | 77.202           | 0,57              |
| SANOFI   | 1.040   | EUR    | 85.119           | 94.599           | 0,70              |
| TOTALENERGIES SE   | 460     | EUR    | 18.594           | 29.196           | 0,22              |
|  |         |        | <b>270.939</b>   | <b>401.862</b>   | <b>2,99</b>       |
| <b>Alemania</b>  |         |        |                  |                  |                   |
| ALLIANZ SE /NAM. VINKULIERT  | 405     | EUR    | 64.429           | 112.509          | 0,84              |
|  |         |        | <b>64.429</b>    | <b>112.509</b>   | <b>0,84</b>       |

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## ESTADO DE INVERSIONES Y OTRO PATRIMONIO NETO (continuación)

### a 31 de marzo de 2024

(expresado en EUR)

| Descripción  | Cant.   | Divisa | Coste             | Valor de mercado  | % patrimonio neto |
|--|---------|--------|-------------------|-------------------|-------------------|
| <b>Suiza</b>   |         |        |                   |                   |                   |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT NAM-AK  | 725     | CHF    | 44.839            | 102.458           | 0,76              |
| NESTLE /ACT NOM  | 1.500   | CHF    | 144.538           | 147.617           | 1,10              |
| ROCHE HOLDING AG /GENUSSSCHEIN   | 900     | CHF    | 257.375           | 212.475           | 1,59              |
|  |         |        | <b>446.752</b>    | <b>462.550</b>    | <b>3,45</b>       |
| <b>Países Bajos</b>  |         |        |                   |                   |                   |
| ASML HOLDING NV  | 60      | EUR    | 28.915            | 53.532            | 0,40              |
|  |         |        | <b>28.915</b>     | <b>53.532</b>     | <b>0,40</b>       |
| <b>Estados Unidos de América</b>   |         |        |                   |                   |                   |
| 3M CO  | 845     | USD    | 122.116           | 83.078            | 0,62              |
| ALPHABET INC -C-   | 1.375   | USD    | 135.459           | 194.056           | 1,45              |
| BANK OF AMERICA CORP   | 19.750  | USD    | 560.565           | 694.184           | 5,17              |
| BIOGEN INC   | 2.550   | USD    | 623.210           | 509.669           | 3,80              |
| GILEAD SCIENCES INC.   | 8.200   | USD    | 496.438           | 556.750           | 4,15              |
| QUALCOMM INC.  | 3.450   | USD    | 401.503           | 541.396           | 4,04              |
| TAPESTRY INC   | 2.000   | USD    | 63.231            | 88.020            | 0,66              |
|  |         |        | <b>2.402.522</b>  | <b>2.667.153</b>  | <b>19,89</b>      |
| <b>Total - Acciones</b>  |         |        | <b>3.600.891</b>  | <b>3.999.427</b>  | <b>29,82</b>      |
| <b>Letras del Tesoro</b>   |         |        |                   |                   |                   |
| <b>España</b>  |         |        |                   |                   |                   |
| SPANISH GOV 0% 23-05.07.24 TB  | 700.000 | EUR    | 688.372           | 693.245           | 5,17              |
| SPANISH GOV 0% 23-06.09.24 TB  | 200.000 | EUR    | 194.102           | 196.850           | 1,47              |
| SPANISH GOV 0% 23-08.11.24 TB  | 400.000 | EUR    | 390.436           | 391.388           | 2,92              |
| SPANISH GOV 0% 23-10.05.24 TB  | 500.000 | EUR    | 484.424           | 498.080           | 3,71              |
|  |         |        | <b>1.757.334</b>  | <b>1.779.563</b>  | <b>13,27</b>      |
| <b>Total - Letras del Tesoro</b>   |         |        | <b>1.757.334</b>  | <b>1.779.563</b>  | <b>13,27</b>      |
| <b>Total - Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización oficial o negociados en otro mercado regulado</b> |         |        | <b>12.032.687</b> | <b>12.431.408</b> | <b>92,69</b>      |
| <b>TOTAL CARTERA DE INVERSIÓN</b>  |         |        | <b>12.032.687</b> | <b>12.431.408</b> | <b>92,69</b>      |

## PRISMA SICAV - Prisma 30

DESGLOSE DE INVERSIONES  
a 31 de marzo de 2024

(expresado como porcentaje del patrimonio neto)

| <b>Área geográfica</b>    | <b>%</b>     | <b>Sector económico</b>              | <b>%</b>     |
|---------------------------|--------------|--------------------------------------|--------------|
| Estados Unidos de América | 43,78        | Estados, provincias y municipios     | 41,76        |
| España                    | 17,72        | Bancos e instituciones financieras   | 8,84         |
| Alemania                  | 11,21        | Software de Internet                 | 7,02         |
| Francia                   | 8,07         | Productos farmacéuticos y cosméticos | 6,66         |
| Países Bajos              | 6,21         | Sociedades de cartera y financieras  | 6,00         |
| Suiza                     | 3,45         | Semiconductores electrónicos         | 5,22         |
| Islas Caimán              | 2,25         | Transmisión de noticias              | 5,16         |
|                           | <b>92,69</b> | Biotecnología                        | 4,15         |
|                           |              | Otros servicios                      | 2,94         |
|                           |              | Seguros                              | 1,62         |
|                           |              | Alimentación y destilerías           | 1,10         |
|                           |              | Productos químicos                   | 0,72         |
|                           |              | Textil                               | 0,66         |
|                           |              | Bienes de consumo                    | 0,62         |
|                           |              | Petróleo                             | 0,22         |
|                           |              |                                      | <b>92,69</b> |

## ESTADO DE INVERSIONES Y OTRO PATRIMONIO NETO a 31 de marzo de 2024

(expresado en EUR)

| Descripción  | Cant.   | Divisa | Coste            | Valor de mercado | % patrimonio neto |
|--|---------|--------|------------------|------------------|-------------------|
| <b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización oficial o negociados en otro mercado regulado</b> |         |        |                  |                  |                   |
| <b>Bonos</b>   |         |        |                  |                  |                   |
| <b>Francia</b>   |         |        |                  |                  |                   |
| LVMH 0,75% 20-07.04.25   | 700.000 | EUR    | 680.010          | 681.310          | 3,19              |
|  |         |        | <b>680.010</b>   | <b>681.310</b>   | <b>3,19</b>       |
| <b>Alemania</b>  |         |        |                  |                  |                   |
| GERMANY 1.5% 14-15.05.24   | 600.000 | EUR    | 610.290          | 598.386          | 2,80              |
|  |         |        | <b>610.290</b>   | <b>598.386</b>   | <b>2,80</b>       |
| <b>Países Bajos</b>  |         |        |                  |                  |                   |
| ING GROUP 0,1% 19-03.09.25   | 500.000 | EUR    | 472.758          | 491.895          | 2,30              |
|  |         |        | <b>472.758</b>   | <b>491.895</b>   | <b>2,30</b>       |
| <b>Estados Unidos de América</b>   |         |        |                  |                  |                   |
| BERKSHIRE 0,0% 20-12.03.25   | 450.000 | EUR    | 423.563          | 434.956          | 2,04              |
| BOOKING HLD 0,10% 21-08.03.25  | 670.000 | EUR    | 645.880          | 647.984          | 3,03              |
| CORNING 3.875% 23-15.05.26   | 400.000 | EUR    | 396.000          | 400.540          | 1,87              |
| USA 2.125% 17-30.09.24 /TBO  | 820.000 | USD    | 797.813          | 748.430          | 3,50              |
| USA 2.5% 14-15.05.24 /TBO  | 800.000 | USD    | 727.343          | 738.750          | 3,46              |
| USA 2.625% 18-31.03.25 /TBO  | 700.000 | USD    | 599.823          | 633.835          | 2,97              |
| XILINX 2,95% 17-01.06.24   | 640.000 | USD    | 603.624          | 590.353          | 2,76              |
|  |         |        | <b>4.194.046</b> | <b>4.194.848</b> | <b>19,63</b>      |
| <b>Total - Bonos</b>   |         |        | <b>5.957.104</b> | <b>5.966.439</b> | <b>27,92</b>      |
| <b>Acciones</b>  |         |        |                  |                  |                   |
| <b>Islas Caimán</b>  |         |        |                  |                  |                   |
| ALIBABA GROUP HOLDING LTD /ADR   | 11.600  | USD    | 1.144.795        | 778.028          | 3,64              |
|  |         |        | <b>1.144.795</b> | <b>778.028</b>   | <b>3,64</b>       |
| <b>Francia</b>   |         |        |                  |                  |                   |
| AIR LIQUIDE  | 1.100   | EUR    | 129.031          | 212.124          | 0,99              |
| AXA  | 6.180   | EUR    | 121.870          | 215.157          | 1,01              |
| L OREAL  | 217     | EUR    | 69.612           | 95.187           | 0,45              |
| SANOFI   | 3.600   | EUR    | 300.301          | 327.456          | 1,53              |
| TOTALENERGIES SE   | 1.361   | EUR    | 57.376           | 86.382           | 0,40              |
|  |         |        | <b>678.190</b>   | <b>936.306</b>   | <b>4,38</b>       |
| <b>Alemania</b>  |         |        |                  |                  |                   |
| ALLIANZ SE /NAM.VINKULIERT   | 780     | EUR    | 128.543          | 216.684          | 1,02              |
| BMW-BAYER. MOTORENWERKE  | 2.700   | EUR    | 185.193          | 288.792          | 1,35              |
|  |         |        | <b>313.736</b>   | <b>505.476</b>   | <b>2,37</b>       |
| <b>Japón</b>   |         |        |                  |                  |                   |
| CANON INC.   | 3.200   | JPY    | 93.034           | 88.192           | 0,41              |
| FANUC CORP --- SHS   | 4.300   | JPY    | 155.622          | 111.110          | 0,52              |
|  |         |        | <b>248.656</b>   | <b>199.302</b>   | <b>0,93</b>       |

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## PRISMA SICAV - Prisma 60

ESTADO DE INVERSIONES Y OTRO PATRIMONIO NETO (continuación)  
a 31 de marzo de 2024

(expresado en EUR)

| Descripción  | Cant.   | Divisa | Coste             | Valor de mercado  | % patrimonio neto |
|--|---------|--------|-------------------|-------------------|-------------------|
| <b>Suiza</b>   |         |        |                   |                   |                   |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT NAM-AK  | 2.150   | CHF    | 159.837           | 303.841           | 1,42              |
| NESTLE /ACT NOM  | 2.150   | CHF    | 223.549           | 211.584           | 0,99              |
| ROCHE HOLDING AG /GENUSSSCHEIN   | 1.730   | CHF    | 464.084           | 408.424           | 1,91              |
|  |         |        | <b>847.470</b>    | <b>923.849</b>    | <b>4,32</b>       |
| <b>Taiwán</b>  |         |        |                   |                   |                   |
| TAIWAN SEMICONDUCT.MANUF/SADR  | 6.450   | USD    | 534.128           | 813.387           | 3,81              |
|  |         |        | <b>534.128</b>    | <b>813.387</b>    | <b>3,81</b>       |
| <b>Países Bajos</b>  |         |        |                   |                   |                   |
| ADYEN B.V.144A   | 145     | EUR    | 96.315            | 227.360           | 1,07              |
| ASML HOLDING NV  | 420     | EUR    | 183.771           | 374.724           | 1,75              |
|  |         |        | <b>280.086</b>    | <b>602.084</b>    | <b>2,82</b>       |
| <b>Estados Unidos de América</b>   |         |        |                   |                   |                   |
| 3M CO  | 2.125   | USD    | 300.954           | 208.925           | 0,98              |
| AIRBNB RG-A  | 378     | USD    | 37.900            | 57.798            | 0,27              |
| ALBEMARLE CORP   | 1.800   | USD    | 216.562           | 219.801           | 1,03              |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC  | 2.850   | USD    | 354.278           | 394.802           | 1,85              |
| ALPHABET INC -C-   | 4.050   | USD    | 340.303           | 571.584           | 2,67              |
| BANK OF AMERICA CORP   | 36.300  | USD    | 1.017.592         | 1.275.892         | 5,97              |
| BIOGEN INC   | 4.525   | USD    | 1.185.479         | 904.413           | 4,23              |
| CITIGROUP INC  | 5.000   | USD    | 212.930           | 293.090           | 1,37              |
| CUMMINS INC  | 800     | USD    | 116.279           | 218.492           | 1,02              |
| DOCUSIGN INC   | 2.079   | USD    | 210.609           | 114.756           | 0,54              |
| GILEAD SCIENCES INC.   | 15.700  | USD    | 932.829           | 1.065.973         | 4,99              |
| INCYTE CORPORATION   | 5.500   | USD    | 391.949           | 290.434           | 1,36              |
| INTUITIVE SURGICAL INC   | 980     | USD    | 123.747           | 362.523           | 1,70              |
| PEPSICO INC.   | 1.100   | USD    | 113.637           | 178.441           | 0,84              |
| QUALCOMM INC.  | 5.900   | USD    | 686.756           | 925.865           | 4,33              |
| TAPESTRY INC   | 5.750   | USD    | 134.067           | 253.056           | 1,18              |
| TESLA INC  | 700     | USD    | 104.648           | 114.059           | 0,53              |
| VICTORIAS SC RG-WI   | 12.250  | USD    | 203.651           | 220.054           | 1,03              |
|  |         |        | <b>6.684.170</b>  | <b>7.669.958</b>  | <b>35,89</b>      |
| <b>Total - Acciones</b>  |         |        | <b>10.731.231</b> | <b>12.428.390</b> | <b>58,16</b>      |
| <b>Letras del Tesoro</b>   |         |        |                   |                   |                   |
| <b>España</b>  |         |        |                   |                   |                   |
| SPANISH GOV 0% 23-08.11.24 TB  | 650.000 | EUR    | 634.459           | 636.005           | 2,97              |
| SPANISH GOV 0% 23-10.05.24 TB  | 600.000 | EUR    | 581.309           | 597.696           | 2,80              |
|  |         |        | <b>1.215.768</b>  | <b>1.233.701</b>  | <b>5,77</b>       |
| <b>Total - Letras del Tesoro</b>   |         |        | <b>1.215.768</b>  | <b>1.233.701</b>  | <b>5,77</b>       |
| <b>Total - Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización oficial o negociados en otro mercado regulado</b> |         |        | <b>17.904.103</b> | <b>19.628.530</b> | <b>91,85</b>      |
| <b>TOTAL CARTERA DE INVERSIÓN</b>  |         |        | <b>17.904.103</b> | <b>19.628.530</b> | <b>91,85</b>      |

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

# PRISMA SICAV

## PRISMA SICAV - Prisma 60

### DESGLOSE DE INVERSIONES a 31 de marzo de 2024

(expresado como porcentaje del patrimonio neto)

| <b>Área geográfica</b>    | <b>%</b>     | <b>Sector económico</b>              | <b>%</b>     |
|---------------------------|--------------|--------------------------------------|--------------|
| Estados Unidos de América | 55,52        | Estados, provincias y municipios     | 18,50        |
| Francia                   | 7,57         | Productos farmacéuticos y cosméticos | 11,67        |
| España                    | 5,77         | Bancos e instituciones financieras   | 10,71        |
| Alemania                  | 5,17         | Software de Internet                 | 9,88         |
| Países Bajos              | 5,12         | Semiconductores electrónicos         | 8,73         |
| Suiza                     | 4,32         | Biotechnología                       | 6,35         |
| Taiwán                    | 3,81         | Transmisión de noticias              | 6,20         |
| Islas Caimán              | 3,64         | Otros servicios                      | 4,88         |
| Japón                     | 0,93         | Textil                               | 2,21         |
|                           | <b>91,85</b> | Sociedades de cartera y financieras  | 2,04         |
|                           |              | Seguros                              | 2,03         |
|                           |              | Productos químicos                   | 2,02         |
|                           |              | Industria del automóvil              | 1,88         |
|                           |              | Alimentación y destilerías           | 1,83         |
|                           |              | Mecánica, maquinaria                 | 1,02         |
|                           |              | Bienes de consumo                    | 0,98         |
|                           |              | Electrónica y equipos eléctricos     | 0,52         |
|                           |              | Petróleo                             | 0,40         |
|                           |              |                                      | <b>91,85</b> |

## PRISMA SICAV - Prisma Global

ESTADO DE INVERSIONES Y OTRO PATRIMONIO NETO  
a 31 de marzo de 2024

(expresado en EUR)

| Descripción  | Cant.   | Divisa | Coste            | Valor de mercado | % patrimonio neto |
|--|---------|--------|------------------|------------------|-------------------|
| <b>Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización oficial o negociados en otro mercado regulado</b> |         |        |                  |                  |                   |
| <b>Acciones</b>  |         |        |                  |                  |                   |
| <b>Islas Caimán</b>  |         |        |                  |                  |                   |
| ALIBABA GROUP HOLDING LTD /ADR   | 15.100  | USD    | 1.556.480        | 1.012.778        | 2,96              |
| JD. COM INC /ADR   | 11.212  | USD    | 422.880          | 284.652          | 0,83              |
| NIO INC  | 167.000 | USD    | 1.237.350        | 696.575          | 2,04              |
|  |         |        | <b>3.216.710</b> | <b>1.994.005</b> | <b>5,83</b>       |
| <b>Francia</b>   |         |        |                  |                  |                   |
| L OREAL  | 110     | EUR    | 33.276           | 48.252           | 0,14              |
| SANOFI   | 3.500   | EUR    | 284.604          | 318.360          | 0,93              |
| VALEO SA   | 24.200  | EUR    | 396.595          | 280.478          | 0,82              |
|  |         |        | <b>714.475</b>   | <b>647.090</b>   | <b>1,89</b>       |
| <b>Alemania</b>  |         |        |                  |                  |                   |
| BMW-BAYER. MOTORENWERKE  | 2.341   | EUR    | 143.455          | 250.393          | 0,73              |
|  |         |        | <b>143.455</b>   | <b>250.393</b>   | <b>0,73</b>       |
| <b>Gran Bretaña</b>  |         |        |                  |                  |                   |
| RENISHAW PLC   | 11.291  | GBP    | 516.276          | 561.399          | 1,64              |
|  |         |        | <b>516.276</b>   | <b>561.399</b>   | <b>1,64</b>       |
| <b>Irlanda</b>   |         |        |                  |                  |                   |
| RYANAIR HOLDINGS PLC   | 24.250  | EUR    | 265.931          | 509.978          | 1,49              |
|  |         |        | <b>265.931</b>   | <b>509.978</b>   | <b>1,49</b>       |
| <b>Israel</b>  |         |        |                  |                  |                   |
| CHECK POINT SOFTWARE TECHNO  | 2.669   | USD    | 206.081          | 405.749          | 1,18              |
| INMODE LTD.  | 31.200  | USD    | 813.025          | 624.955          | 1,83              |
|  |         |        | <b>1.019.106</b> | <b>1.030.704</b> | <b>3,01</b>       |
| <b>Japón</b>   |         |        |                  |                  |                   |
| CANON INC.   | 7.900   | JPY    | 196.294          | 217.724          | 0,64              |
| FANUC CORP --- SHS   | 20.600  | JPY    | 661.272          | 532.292          | 1,56              |
| HONDA MOTOR CO. LTD  | 7.200   | JPY    | 60.058           | 82.155           | 0,24              |
| TORAY INDUSTRIES INC.  | 19.700  | JPY    | 131.778          | 87.525           | 0,25              |
| TOYOTA MOTOR CORP  | 6.800   | JPY    | 80.139           | 158.470          | 0,46              |
|  |         |        | <b>1.129.541</b> | <b>1.078.166</b> | <b>3,15</b>       |
| <b>España</b>  |         |        |                  |                  |                   |
| AMADEUS IT --- SHS -A-   | 4.120   | EUR    | 206.388          | 244.893          | 0,72              |
| LÍNEA DIRECTA BR   | 289.516 | EUR    | 341.109          | 267.802          | 0,78              |
|  |         |        | <b>547.497</b>   | <b>512.695</b>   | <b>1,50</b>       |
| <b>Suecia</b>  |         |        |                  |                  |                   |
| ASSA ABLOY AB  | 3.179   | SEK    | 54.433           | 84.540           | 0,25              |
|  |         |        | <b>54.433</b>    | <b>84.540</b>    | <b>0,25</b>       |

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## PRISMA SICAV - Prisma Global

ESTADO DE INVERSIONES Y OTRO PATRIMONIO NETO (continuación)  
a 31 de marzo de 2024

(expresado en EUR)

| Descripción  | Cant.  | Divisa | Coste             | Valor de mercado  | % patrimonio neto |
|--|--------|--------|-------------------|-------------------|-------------------|
| <b>Suiza</b>   |        |        |                   |                   |                   |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT NAM-AK  | 2.100  | CHF    | 180.120           | 296.774           | 0,87              |
| GARMIN   | 2.971  | USD    | 199.496           | 409.967           | 1,20              |
| NESTLE /ACT NOM  | 1.100  | CHF    | 114.729           | 108.252           | 0,32              |
| ROCHE HOLDING AG /GENUSSSCHEIN   | 2.800  | CHF    | 751.877           | 661.034           | 1,93              |
|  |        |        | <b>1.246.222</b>  | <b>1.476.027</b>  | <b>4,32</b>       |
| <b>Taiwán</b>  |        |        |                   |                   |                   |
| TAIWAN SEMICONDUCT.MANUF/SADR  | 7.090  | USD    | 688.480           | 894.095           | 2,61              |
|  |        |        | <b>688.480</b>    | <b>894.095</b>    | <b>2,61</b>       |
| <b>Países Bajos</b>  |        |        |                   |                   |                   |
| ADYEN B.V.144A   | 265    | EUR    | 267.269           | 415.520           | 1,21              |
| ASML HOLDING NV  | 605    | EUR    | 286.486           | 539.781           | 1,58              |
|  |        |        | <b>553.755</b>    | <b>955.301</b>    | <b>2,79</b>       |
| <b>Estados Unidos de América</b>   |        |        |                   |                   |                   |
| 3M CO  | 1.300  | USD    | 115.971           | 127.813           | 0,37              |
| AIRBNB RG-A  | 3.050  | USD    | 334.420           | 466.356           | 1,36              |
| ALBEMARLE CORP   | 1.500  | USD    | 238.517           | 183.167           | 0,54              |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC  | 6.708  | USD    | 828.487           | 929.240           | 2,72              |
| ALPHABET INC -C-   | 4.750  | USD    | 491.837           | 670.376           | 1,96              |
| ARCUS BIOSCIENCES INC  | 32.250 | USD    | 593.525           | 564.379           | 1,65              |
| BANK OF AMERICA CORP   | 46.900 | USD    | 1.263.808         | 1.648.466         | 4,82              |
| BIOGEN INC   | 5.684  | USD    | 1.591.155         | 1.136.062         | 3,32              |
| BRISTOL MYERS SQUIBB CO  | 2.770  | USD    | 136.953           | 139.238           | 0,41              |
| CHARLES SCHWAB CORP  | 2.548  | USD    | 127.869           | 170.851           | 0,50              |
| CITIGROUP INC  | 11.100 | USD    | 463.999           | 650.659           | 1,90              |
| COGNEX CORP  | 19.134 | USD    | 959.077           | 752.342           | 2,20              |
| CORNING INC.   | 26.252 | USD    | 568.179           | 802.026           | 2,34              |
| CUMMINS INC  | 1.900  | USD    | 272.808           | 518.918           | 1,52              |
| DOCUSIGN INC   | 7.900  | USD    | 832.018           | 436.062           | 1,27              |
| ENPHASE ENERGY INC SHS   | 4.050  | USD    | 665.057           | 454.159           | 1,33              |
| GILEAD SCIENCES INC.   | 21.350 | USD    | 1.370.354         | 1.449.588         | 4,24              |
| INCYTE CORPORATION   | 13.900 | USD    | 986.642           | 734.007           | 2,15              |
| INTUITIVE SURGICAL INC   | 2.388  | USD    | 361.993           | 883.373           | 2,58              |
| JPMORGAN CHASE & CO  | 2.918  | USD    | 225.897           | 541.758           | 1,58              |
| MICRON TECHNOLOGY INC  | 5.150  | USD    | 262.403           | 562.760           | 1,64              |
| MORGAN STANLEY   | 7.873  | USD    | 324.665           | 687.141           | 2,01              |
| PALANTIR TCHNL-A RG  | 14.900 | USD    | 106.884           | 317.791           | 0,93              |
| QUALCOMM INC.  | 10.230 | USD    | 1.259.516         | 1.605.357         | 4,69              |
| QUANTUMSCAPE CORP A  | 21.300 | USD    | 146.170           | 124.185           | 0,36              |
| SAGE THERAPEUTICS INC  | 26.500 | USD    | 876.828           | 460.314           | 1,35              |
| TAPESTRY INC   | 23.450 | USD    | 513.174           | 1.032.030         | 3,02              |
| TELADOC HEALTH INC   | 20.347 | USD    | 1.306.702         | 284.784           | 0,83              |
| TESLA INC  | 2.200  | USD    | 365.897           | 358.472           | 1,05              |
| TWILIO INC -A-   | 2.284  | USD    | 450.137           | 129.459           | 0,38              |
| VICTORIAS SC RG-WI   | 43.976 | USD    | 1.395.333         | 789.966           | 2,31              |
| WALT DISNEY  | 1.170  | USD    | 124.844           | 132.698           | 0,39              |
|  |        |        | <b>19.561.119</b> | <b>19.743.797</b> | <b>57,72</b>      |
| <b>Total - Acciones</b>  |        |        | <b>29.657.000</b> | <b>29.738.190</b> | <b>86,93</b>      |
| <b>Total - Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización oficial o negociados en otro mercado regulado</b> |        |        | <b>29.657.000</b> | <b>29.738.190</b> | <b>86,93</b>      |

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## PRISMA SICAV - Prisma Global

ESTADO DE INVERSIONES Y OTRO PATRIMONIO NETO (continuación)  
a 31 de marzo de 2024

(expresado en EUR)

## Contratos de opciones

| Tipo                                 | Fecha de vencimiento | Precio de ejercicio | Denominación                        | Cant. | Divisa | Coste             | Valor de mercado  | % patrimonio neto |
|--------------------------------------|----------------------|---------------------|-------------------------------------|-------|--------|-------------------|-------------------|-------------------|
| CALL                                 | 19/04/2024           | 110                 | CALL ALBEMARLE CORP                 | 66    | USD    | 115.228           | 134.282           | 0,40              |
| CALL                                 | 17/05/2024           | 70                  | CALL ALIBABA GROUP HOLDING LTD /ADR | 140   | USD    | 64.126            | 64.884            | 0,19              |
| CALL                                 | 19/04/2024           | 70                  | CALL ALIBABA GROUP HOLDING LTD /ADR | 336   | USD    | 199.217           | 104.335           | 0,32              |
| CALL                                 | 19/04/2024           | 15                  | CALL ARCUS BIOSCIENCES INC          | 590   | USD    | 219.332           | 120.313           | 0,35              |
| CALL                                 | 19/04/2024           | 90                  | CALL BAIDU INC -A-/ADR              | 155   | USD    | 219.774           | 221.254           | 0,65              |
| CALL                                 | 17/05/2024           | 200                 | CALL BIOGEN INC                     | 48    | USD    | 96.160            | 81.420            | 0,23              |
| CALL                                 | 19/04/2024           | 210                 | CALL BIOGEN INC                     | 91    | USD    | 134.948           | 66.636            | 0,19              |
| CALL                                 | 19/04/2024           | 60                  | CALL CRISPR THERAPEUTICS LTD        | 175   | USD    | 227.206           | 123.279           | 0,36              |
| CALL                                 | 19/04/2024           | 50                  | CALL DOCUSIGN INC                   | 295   | USD    | 153.926           | 252.931           | 0,74              |
| CALL                                 | 19/04/2024           | 110                 | CALL ENPHASE ENERGY INC SHS         | 135   | USD    | 132.379           | 168.930           | 0,49              |
| CALL                                 | 19/04/2024           | 20                  | CALL INMODE LTD.                    | 610   | USD    | 126.733           | 101.775           | 0,30              |
| CALL                                 | 19/04/2024           | 24                  | CALL JD.COM INC /ADR                | 475   | USD    | 172.299           | 147.495           | 0,43              |
| CALL                                 | 17/05/2024           | 25                  | CALL JD.COM INC /ADR                | 40    | USD    | 11.127            | 10.641            | 0,03              |
| CALL                                 | 17/05/2024           | 4                   | CALL NIO INC                        | 4.500 | USD    | 563.293           | 317.004           | 0,93              |
| CALL                                 | 17/05/2024           | 5                   | CALL QUANTUMSCAPE CORP A            | 400   | USD    | 59.421            | 55.244            | 0,16              |
| CALL                                 | 16/08/2024           | 5                   | CALL QUANTUMSCAPE CORP A            | 500   | USD    | 89.961            | 82.032            | 0,24              |
| CALL                                 | 19/04/2024           | 18                  | CALL SAGE THERAPEUTICS INC          | 155   | USD    | 49.812            | 21.551            | 0,06              |
| CALL                                 | 17/05/2024           | 18                  | CALL SAGE THERAPEUTICS INC          | 340   | USD    | 101.849           | 86.666            | 0,25              |
| CALL                                 | 17/05/2024           | 125                 | CALL TAIWAN SEMICONDUCT.MANUF/SADR  | 103   | USD    | 127.810           | 137.957           | 0,40              |
| CALL                                 | 19/04/2024           | 15                  | CALL TELADOC HEALTH INC             | 680   | USD    | 91.313            | 39.079            | 0,11              |
| CALL                                 | 19/04/2024           | 360                 | CALL VERTEX PHARMACEUTICALS         | 5     | USD    | 29.066            | 25.675            | 0,08              |
| CALL                                 | 19/04/2024           | 15                  | CALL VICTORIAS SC RG-WI             | 200   | USD    | 72.897            | 81.568            | 0,24              |
| <b>Total - Contratos de opciones</b> |                      |                     |                                     |       |        | <b>3.057.877</b>  | <b>2.444.951</b>  | <b>7,15</b>       |
| <b>TOTAL CARTERA DE INVERSIÓN</b>    |                      |                     |                                     |       |        | <b>32.714.877</b> | <b>32.183.141</b> | <b>94,08</b>      |

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

## PRISMA SICAV - Prisma Global

DESGLOSE DE INVERSIONES  
a 31 de marzo de 2024

(expresado como porcentaje del patrimonio neto)

| <b>Área geográfica</b>    | <b>%</b>     | <b>Sector económico</b>                  | <b>%</b>     |
|---------------------------|--------------|--|--------------|
| Estados Unidos de América | 61,26        | Productos farmacéuticos y cosméticos     | 16,94        |
| Islas Caimán              | 8,38         | Software de Internet                     | 11,30        |
| Suiza                     | 4,68         | Semiconductores electrónicos             | 10,71        |
| Israel                    | 3,31         | Bancos e instituciones financieras       | 9,51         |
| Japón                     | 3,15         | Biotecnología                            | 8,13         |
| Taiwán                    | 3,01         | Transmisión de noticias                  | 7,03         |
| Países Bajos              | 2,79         | Industria del automóvil                  | 6,27         |
| Francia                   | 1,89         | Sociedades de cartera y financieras      | 5,76         |
| Gran Bretaña              | 1,64         | Textil                                   | 5,57         |
| España                    | 1,50         | Otros servicios                          | 2,23         |
| Irlanda                   | 1,49         | Servicios públicos                       | 1,82         |
| Alemania                  | 0,73         | Mecánica, maquinaria                     | 1,77         |
| Suecia                    | 0,25         | Electrónica y equipos eléctricos         | 1,56         |
|                           | <b>94,08</b> | Transporte                               | 1,49         |
|                           |              | Productos químicos                       | 1,19         |
|                           |              | Educación sanitaria y servicios sociales | 0,94         |
|                           |              | Seguros                                  | 0,78         |
|                           |              | Artes gráficas, edición                  | 0,39         |
|                           |              | Bienes de consumo                        | 0,37         |
|                           |              | Alimentación y destilerías               | 0,32         |
|                           |              |  | <b>94,08</b> |

## Notas a los estados financieros a 31 de marzo de 2024

### NOTA 1 - GENERAL

PRISM@ SICAV (la “Compañía” o “PRISMA SICAV”) es una sociedad de inversión de capital variable de tipo abierto, constituida en el Gran Ducado de Luxemburgo como sociedad anónima (*société anonyme*) de conformidad con la Ley de 10 de agosto de 1915 en su versión modificada, y está calificada como Sociedad de Inversión de Capital Variable (*Société d'Investissement à Capital Variable* o “SICAV”) de conformidad con la parte I de la Ley de 17 de diciembre de 2010 (la “Ley de 2010”) relativa a organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios, en su versión modificada.

El 1 de julio de 2016, la Compañía designó a BIL Manage Invest S.A. como Sociedad Gestora.

BIL Manage Invest S.A. es una sociedad anónima (*société anonyme*). Se constituyó en Luxemburgo el 28 de junio de 2013. Su domicilio social es 69, route d'Esch, L-1470 Luxemburgo, Gran Ducado de Luxemburgo. Su capital social ascendía a ochocientos mil euros (800.000 EUR) a 31 de diciembre de 2017.

BIL Manage Invest S.A. está aprobada por la CSSF como sociedad gestora de Organismos de Inversión Colectiva en Valores Mobiliarios (OICVM) regulada por el capítulo 15 de la Ley de 2010, y como gestora de fondos de inversión alternativos de acuerdo con el redactado del artículo 1(46) de la Ley de 12 de julio de 2013 sobre gestores de fondos de inversión alternativos, en su versión modificada.

La Sociedad Gestora, con el consentimiento de la Compañía, ha designado a Prisma Global Asset Management Sociedad Gestora de Instituciones de Inversión Colectiva S.A., (“Prisma S.G.I.I.C., S.A.”), en virtud de un acuerdo de fecha 31 de agosto de 2018, como Gestor de Inversiones de los siguientes subfondos respectivos:

| Subfondo                               | Gestor de Inversiones   |
|--|-------------------------|
| PRISMA SICAV - Merchbank Global in USD | Prisma S.G.I.I.C., S.A. |
| PRISMA SICAV - Cube                    | Prisma S.G.I.I.C., S.A. |
| PRISMA SICAV - Prisma 30               | Prisma S.G.I.I.C., S.A. |
| PRISMA SICAV - Prisma 60               | Prisma S.G.I.I.C., S.A. |
| PRISMA SICAV - Prisma Global           | Prisma S.G.I.I.C., S.A. |

La Compañía se constituyó en Luxemburgo el 14 de julio de 1995 por tiempo indefinido, con un capital inicial de 45.000 USD. Las últimas modificaciones de los Estatutos de la Compañía se realizaron el 19 de abril de 2021. Los Estatutos modificados se publicaron en el “Mémorial C, Recueil des Sociétés et Associations” de Luxemburgo. La Compañía está inscrita en el “Registre de Commerce et des Sociétés” de Luxemburgo con el número B-51646.

El capital de la Compañía está representado por acciones sin valor nominal y equivale en todo momento al patrimonio neto total de la Compañía.

Los Estatutos de la Compañía están depositados en el “Registre de Commerce et des Sociétés” de Luxemburgo, donde pueden consultarse y obtenerse copias previo pago de los costes correspondientes.

A 31 de marzo de 2024, la Compañía mantiene activos cinco subfondos:

- PRISMA SICAV - Merchbank Global in USD (expresado en USD)
- PRISMA SICAV - Cube (expresado en EUR)
- PRISMA SICAV - Prisma 30 (expresado en EUR)
- PRISMA SICAV - Prisma 60 (expresado en EUR)
- PRISMA SICAV - Prisma Global (expresado en EUR)

Los Estatutos de la Compañía permiten al Consejo de Administración de la Compañía crear subfondos adicionales.

El objetivo de la Compañía es ofrecer a los suscriptores una variedad de subfondos que inviertan en una amplia gama de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario a escala mundial, con diversos objetivos de inversión, incluidos el crecimiento del capital y los ingresos, sin renunciar a las ventajas administrativas de una única entidad corporativa.

De conformidad con las condiciones establecidas en el folleto, los accionistas pueden convertir las acciones de cualquier subfondo en acciones de cualquier otro subfondo existente. El estado de cambios en las inversiones está disponible gratuitamente previa solicitud en el domicilio social de la Compañía.

### NOTA 2 - RESUMEN DE LAS POLÍTICAS CONTABLES SIGNIFICATIVAS

Los estados financieros de la Compañía se presentan de conformidad con las disposiciones legales y reglamentarias de Luxemburgo relativas a los Organismos de Inversión Colectiva en Valores Mobiliarios. Se presentan de conformidad con las políticas contables generalmente aceptadas en Luxemburgo.

#### a) Valoración de las inversiones en valores

1 - El valor de los valores, de los instrumentos del mercado monetario y/o de los instrumentos financieros derivados que cotizan o se negocian en cualquier bolsa de valores o que se negocian en otro mercado regulado es, para cada valor, el último precio conocido y, si dichos valores se negocian en varios mercados, se basa en el último precio conocido en la bolsa de valores que normalmente es el principal mercado para dicho valor.

Los precios utilizados a efectos de valoración son los precios a 31 de marzo de 2024 para todos los subfondos.

## Notas a los estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

### NOTA 2 - RESUMEN DE LAS POLÍTICAS CONTABLES SIGNIFICATIVAS (continuación)

#### a) Valoración de las inversiones en valores (continuación)

2 - En el caso de que alguno de los valores mantenidos en cualquier cartera en el día de valoración pertinente no cotice o no se negocie en una bolsa de valores o en otro mercado regulado o, en el caso de determinados valores, no se disponga de ninguna cotización, o si el precio determinado de conformidad con el párrafo 1 anterior no es, en opinión del Consejo de Administración de la Compañía, representativo del valor justo de mercado de los valores en cuestión, el valor de dichos valores se determinará sobre la base del precio de venta razonablemente previsible determinado con prudencia y de buena fe por el Consejo de Administración de la Compañía.

#### b) Ingresos

Los dividendos se contabilizan en la fecha ex-dividendo. Los ingresos por intereses se registran según el principio del devengo. Los descuentos de los bonos de cupón cero se contabilizan como ajustes de los ingresos por intereses.

#### c) Beneficio/(pérdida) neto materializado por ventas de inversiones

El beneficio/(pérdida) neto materializado por ventas de inversiones se calcula sobre la base del coste medio de los valores vendidos.

#### d) Conversión de divisas de cada subfondo

El balance de situación combinado y el estado de resultados y variaciones del patrimonio neto combinado son la suma del balance de situación y del estado de resultados y variaciones del patrimonio neto de cada subfondo convertidos y expresados en EUR a los tipos de cambio aplicables a 31 de marzo de 2024, según la última información disponible en dicha fecha.

Los ingresos y los gastos en divisas distintas del euro se convierten en euros a los tipos de cambio vigentes en la fecha de la transacción.

Todos los activos valorados en una divisa distinta de la divisa base del subfondo se convierten a la divisa base a los tipos de cambio vigentes a 31 de marzo de 2024, según la última información disponible en dicha fecha.

Tipos de cambio utilizados a 31 de marzo de 2024, basados en la última información disponible

en esa fecha. 1 EUR = 0,972961 CHF

1 EUR = 0,854772 GBP

1 EUR = 163,316374 JPY

1 EUR = 11,548013 SEK

1 EUR = 1,078850 USD

#### e) Cambios de divisa

Este importe se explica por la diferencia entre el tipo de cambio aplicado a 31 de marzo de 2023 y el aplicado a 31 de marzo de 2024 para el cálculo del patrimonio neto al inicio del ejercicio de los subfondos expresado en divisas distintas del EUR.

#### f) Coste de la inversión en valores de cada subfondo

El coste de la inversión en valores expresado en divisas distintas de la divisa del subfondo se convierte a la divisa del subfondo al tipo de cambio aplicable en la fecha de compra.

#### g) Valoración de los contratos de futuros

La valoración de los contratos de futuros admitidos a cotización oficial o en cualquier otro mercado organizado se basa en el último precio conocido. Los contratos de futuros que no cotizan ni se negocian en una bolsa de valores ni en ningún otro mercado organizado se valoran a su valor probable de mercado estimado de forma prudente y de buena fe por el Consejo de Administración de la Compañía. Los contratos de futuros abiertos a 31 de marzo de 2024 se detallan en la Nota 7.

Los márgenes de garantía se indican en el epígrafe “Margen a pagar al intermediario” del Balance de situación.

El beneficio/(pérdida) neto realizado y la variación en las plusvalías/(minusvalías) netas latentes se indican en el Estado de resultados y variaciones del patrimonio neto.

#### h) Valoración de los contratos de opciones

Los contratos de opciones negociados en un mercado regulado se valoran al último precio de oferta en la fecha de valoración. El beneficio/(pérdida) neto realizado y la variación en las plusvalías/(minusvalías) netas latentes se indican en el Estado de resultados y variaciones del patrimonio neto. Los contratos de opciones figuran en el Estado de inversiones y otro patrimonio neto.

## Notas a los estados financieros a 31 de marzo de 2024

### NOTA 3 - COMISIONES DE GESTIÓN Y DE RENTABILIDAD

En virtud de un acuerdo de fecha 31 de agosto de 2018, la Sociedad Gestora, con el consentimiento de la Compañía, ha designado a Prisma S.G.I.I.C., S.A. para que actúe como Gestor de Inversiones de PRISMA SICAV - Merchbank Global in USD, PRISMA SICAV - Cube, PRISMA SICAV - Prisma 30, PRISMA SICAV - Prisma 60 y PRISMA SICAV - Prisma Global.

Como remuneración por sus servicios, los Gestores de Inversiones reciben de la Compañía una comisión mensual según los siguientes porcentajes anuales aplicables sobre el patrimonio neto medio de cada subfondo:

- 1,50% en el caso de PRISMA SICAV - Merchbank Global in USD
- 1,30% en el caso de PRISMA SICAV - Cube
- 1,30% en el caso de PRISMA SICAV - Prisma 30
- 1,50% en el caso de PRISMA SICAV - Prisma 60
- 1,35% en el caso de PRISMA SICAV - Prisma Global

La Compañía también paga a los Gestores de Inversiones una comisión de rentabilidad adicional.

En el caso del subfondo PRISMA SICAV - Merchbank Global in USD, Prisma S.G.I.I.C., S.A. percibe una comisión de rentabilidad del 10% del incremento del patrimonio neto total del subfondo calculado sobre un periodo de 12 meses, correspondiente en la práctica a un ejercicio. El primer periodo de rentabilidad del subfondo comienza en su fecha de lanzamiento, teniendo en cuenta que la primera materialización de las comisiones de rentabilidad solo debería producirse tras un periodo mínimo de doce meses a partir de la fecha de lanzamiento. La comisión de rentabilidad se abona anualmente a plazo vencido al final de cada ejercicio.

En el caso del subfondo PRISMA SICAV - Prisma Global, Prisma S.G.I.I.C., S.A. percibe una comisión de rentabilidad del 9% del incremento del patrimonio neto total del subfondo calculado sobre un periodo de 12 meses, correspondiente en la práctica a un ejercicio. El primer periodo de rentabilidad del subfondo comienza en su fecha de lanzamiento, teniendo en cuenta que la primera materialización de las comisiones de rentabilidad solo debería producirse tras un periodo mínimo de doce meses a partir de la fecha de lanzamiento. La comisión de rentabilidad se abona anualmente a plazo vencido al final de cada ejercicio.

La comisión de rentabilidad, con respecto a los subfondos PRISMA SICAV - Merchbank Global in USD y PRISMA SICAV - Prisma Global, se calcula y devenga cada día de valoración, siempre que el valor liquidativo actual sea superior al *High Watermark* ajustado (tal y como se define a continuación), sobre la base de los activos brutos determinados en cada día de valoración, tras deducir todos los gastos y la comisión de gestión (pero no la comisión de rentabilidad) y aplicar los ajustes por suscripciones, reembolsos y conversiones (si procede) en el día de valoración pertinente, de modo que no afecten a la comisión de rentabilidad pagadera.

En caso de rentabilidad inferior en el último día de valoración de un ejercicio, no se materializará ni se abonará al Gestor de Inversiones ninguna comisión de rentabilidad; el *High Watermark* ("HWM") ajustado no se modificará al inicio del nuevo periodo y el periodo de cálculo se prorrogará para un nuevo ejercicio. El periodo de cálculo se ampliará hasta que se recupere la rentabilidad inferior anterior, hasta un máximo de cinco ejercicios consecutivos.

Las pérdidas únicamente podrán restablecerse al cabo de cinco años de rentabilidad inferior, mediante la anulación del primer año de rentabilidad del periodo de referencia de rentabilidad en curso de los subfondos. El periodo de referencia de rentabilidad es el horizonte temporal en el que se mide la rentabilidad, al final del cual puede restablecerse el mecanismo de compensación de las rentabilidades inferiores pasadas.

La materialización de la comisión de rentabilidad se produce en la última valoración de cada ejercicio. Toda comisión de rentabilidad adeudada se pagará al Gestor de Inversiones con cargo al subfondo a plazo vencido tras el cierre del ejercicio.

En consecuencia, una vez que la comisión de rentabilidad se haya materializado, no se reembolsará ninguna comisión de rentabilidad que se haya abonado hasta ese momento en los siguientes ejercicios.

Si se produce un reembolso neto y/o una conversión de acciones en cualquier día de valoración antes del cierre de un ejercicio, cualquier comisión de rentabilidad acumulada con respecto a las acciones reembolsadas se materializará en dicha valoración y será entonces pagadera al Gestor de Inversiones.

Prisma S.G.I.I.C., S.A. no percibió ninguna comisión de rentabilidad durante el periodo finalizado el 31 de marzo de 2024 por los subfondos PRISMA SICAV - Merchbank Global in USD, PRISMA SICAV - Cube, PRISMA SICAV - Prisma 30, PRISMA SICAV - Prisma 60 y PRISMA SICAV - Prisma Global.

Como remuneración por sus servicios, la Sociedad Gestora tiene derecho a recibir desde el 4 de mayo de 2020 una comisión anual de Sociedad Gestora, que se calcula y paga trimestralmente a plazo vencido de la siguiente manera:

| Total activos gestionados              | Comisiones                 |
|--|----------------------------|
| Primeros 50 millones € por subfondo    | 9 p.b. por subfondo al año |
| Entre 50 y 100 millones € por subfondo | 8 p.b. por subfondo al año |
| Más de 100 millones € por subfondo     | 7 p.b. por subfondo al año |

Con independencia del valor liquidativo del subfondo, la Sociedad Gestora tendrá derecho a percibir una comisión mínima anual que ascenderá al mayor de los siguientes importes: 10.000 euros por Subfondo con carácter quincenal y 12.000 euros por Subfondo con carácter diario, u 80.000 euros a nivel de la Compañía.

**Notas a los estados financieros a  
31 de marzo de 2024  
(continuación)**

**NOTA 4 - IMPUESTO DE SUSCRIPCIÓN**

De acuerdo con la legislación y la práctica actuales, la Compañía no está sujeta a ningún impuesto sobre la renta luxemburgués, ni los dividendos pagados por la Compañía están sujetos a ninguna retención fiscal luxemburguesa. No obstante, la Compañía está sujeta en Luxemburgo a un impuesto de suscripción del 0,05% anual de su patrimonio neto, pagadero trimestralmente y calculado sobre la base del patrimonio neto de todos sus subfondos al final del trimestre correspondiente.

No se devengará ningún impuesto de suscripción sobre los activos que la Compañía posea en otros OICVM que ya estén sujetos a dicho impuesto en Luxemburgo.

**Nota 5 - AGENTE DE ADMINISTRACIÓN CENTRAL, AGENTE DEPOSITARIO Y AGENTE DE REGISTRO Y TRANSFERENCIAS**

La Compañía paga al Agente Depositario y al Agente de Administración Central unos honorarios anuales de entre el 0,03% y el 0,052% del valor liquidativo del Subfondo, con unos honorarios mínimos de 29.000 euros por Subfondo. Estos honorarios se pagan mensualmente y no incluyen las comisiones por transacción ni los costes de los subcustodios o agentes similares. Además, la Compañía paga unos honorarios mínimos por Subfondo de 6.000 euros anuales al Agente de Registro y Transferencias. El Agente Depositario, el Agente de Administración Central y el Agente de Registro y Transferencias también tienen derecho a que se les reembolsen los desembolsos y gastos de bolsillo razonables que no estén incluidos en los honorarios mencionados.

**NOTA 6 - IMPUESTOS Y GASTOS A PAGAR**

|   | PRISMA SICAV -<br>Merchbanc Global in<br>USD | PRISMA SICAV -<br>Cube | PRISMA SICAV -<br>Prisma 30 | PRISMA SICAV -<br>Prisma 60 |
|---|--|------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
|   | USD  | EUR                    | EUR                         | EUR                         |
| Impuesto de suscripción (Nota 4)  | 1.234  | 2.640                  | 1.637                       | 2.608                       |
| Comisiones del Agente Depositario, de intermediación, de domiciliación, de administración y del Agente de Registro y Transferencias | 6.846  | 6.677                  | 5.724                       | 7.009                       |
| Gastos de auditoría y legales   | 2.137  | 4.895                  | 3.017                       | 4.536                       |
| Honorarios de miembros del Consejo de Administración  | 0  | 694                    | 343                         | 249                         |
| Comisiones sobre resultados   | 1.081  | 989                    | 0                           | 0                           |
| <b>Total</b>  | <b>11.298</b>                                | <b>15.895</b>          | <b>10.721</b>               | <b>14.402</b>               |

|   | PRISMA SICAV -<br>Prisma Global |
|---|---------------------------------|
|   | EUR                             |
| Impuesto de suscripción (Nota 4)  | 4.168                           |
| Comisiones del Agente Depositario, de intermediación, de domiciliación, de administración y del Agente de Registro y Transferencias | 9.869                           |
| Gastos de auditoría y legales   | 8.497                           |
| Honorarios de miembros del Consejo de Administración  | 349                             |
| Comisiones sobre resultados   | 989                             |
| <b>Total</b>  | <b>23.872</b>                   |

**NOTA 7 - CONTRATOS DE FUTUROS**

A 31 de marzo de 2024, la Compañía tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

| Cantidad | Descripción                   | Compra /<br>Venta | Fecha de<br>vencimiento | Compromiso<br>en EUR | (Pérdida) neta<br>latente en<br>EUR |
|----------|-------------------------------|-------------------|-------------------------|----------------------|-------------------------------------|
| 42       | EUR/USD SPOT - CROSS<br>RATES | COMPRA            | 17/06/2024              | 5.265.818,56         | (78.834)<br>(78.834)                |

**Notas a los estados financieros a  
31 de marzo de 2024**

**NOTA 7 - CONTRATOS DE FUTUROS (continuación)**

| Cantidad<br>Venta               | Descripción                   | Compra / | Fecha de<br>vencimient<br>o | Compromiso<br>en EUR | Beneficio/(pér<br>dida) neto<br>latente<br>en EUR |
|---------------------------------|-------------------------------|----------|-----------------------------|----------------------|---|
| <b>PRISMA SICAV - Prisma 60</b> |                               |          |                             |                      |   |
| 5                               | EUR/CHF SPOT CROSS            | COMPRA   | 17/06/2024                  | 619.832,91           | 8.736   |
| 84                              | EUR/USD SPOT - CROSS<br>RATES | COMPRA   | 17/06/2024                  | 10.533.566,24        | (157.668)   |
|                                 |                               |          |                             |                      | <b>(148.932)</b>                                  |

| Cantidad                            | Descripción                   | Compra / Venta | Fecha de<br>vencimiento | Compromiso<br>en EUR | (Pérdida) neta<br>latente en EUR |
|-------------------------------------|-------------------------------|----------------|-------------------------|----------------------|----------------------------------|
| <b>PRISMA SICAV - Prisma Global</b> |                               |                |                         |                      |                                  |
| 125                                 | EUR/USD SPOT - CROSS<br>RATES | COMPRA         | 17/06/2024              | 15.674.949,76        | (234.625)                        |
|                                     |                               |                |                         |                      | <b>(234.625)</b>                 |

**NOTA 8 - ACONTECIMIENTOS OCURRIDOS DURANTE EL PERIODO**

No se produjo ningún otro acontecimiento relevante durante el periodo finalizado el 31 de marzo de 2024.

**NOTA 9 - ACONTECIMIENTOS POSTERIORES**

No se ha producido ningún otro acontecimiento relevante con posterioridad al 31 de marzo de 2024.

## Información no auditada

### **INFORMACIÓN RELATIVA A LA TRANSPARENCIA DE LAS OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES Y DE REUTILIZACIÓN DE GARANTÍAS EN EFECTIVO (REGLAMENTO 2015/2365 DE LA UE, “SFTR”)**

A la fecha de los presentes estados financieros, la Compañía no ha realizado operaciones que estén sujetas al SFTR. Durante el periodo no se realizaron operaciones de este tipo.

### **INFORMACIÓN DE LOS REPRESENTANTES ESPAÑOLES**

PRISMA SICAV es distribuida por Banco Inversis, S.A. y Allfunds Bank, S.A.U., que distribuyen PRISMA SICAV en España y Luxemburgo a través de sus plataformas de fondos. La información pertinente de los subfondos también está disponible en el sitio web de Prisma: [www.prismaam.com](http://www.prismaam.com).

Los subdistribuidores son entidades financieras reguladas supervisadas por la Comisión Nacional del Mercado de Valores (CNMV) y cumplen las normativas AML/CFT, KYC, FATCA y CRS, así como cualquier ley y normativa que pueda ser impuesta por la CNMV y por la CSSF.

Banco Inversis, S.A. y Allfunds Bank, S.A.U. también están supervisados por el Banco de España.

### **DIVULGACIONES CONFORME AL SFDR**

Todos los subfondos se consideran fondos del artículo 6 en virtud del Reglamento SFDR, cuyas inversiones subyacentes no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.