

ALTERALIA DEBT FUND, FIL

Nº Registro CNMV: 55

Informe Semestral del Primer Semestre 2019

Gestora: 1) ALANTRA ASSET MANAGEMENT, SGIIC, S.A. **Depositario:** BANCO INVERDIS, S.A. **Auditor:** DELOITTE, S.L.

Grupo Gestora: **Grupo Depositario:** BANCA MARCH **Rating Depositario:** ND

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

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

Dirección

CL. Padilla, 17
28006 - Madrid

Correo Electrónico

gestión@alantra.com

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

INFORMACIÓN FONDO

Fecha de registro: 12/06/2015

1. Política de inversión y divisa de denominación

Categoría

Tipo de fondo: Fondo de Inversión Libre Vocación inversora: Renta Fija Mixta Euro Perfil de Riesgo: Alto

Descripción general

Política de inversión: Política de inversión: El FIL invertirá prácticamente el 100% de la exposición total en la clase C del compartimento I Compartment ("C") de ALTERALIA SCA SICAR, entidad de capital riesgo luxemburguesa no supervisada por la CNMV, y cuyo folleto no está verificado por la CNMV.

El objetivo de inversión del C es proporcionar rendimientos atractivos ajustados al riesgo mediante la inversión directa o mediante financiación en compañías que facturan aproximadamente entre 25 y 200 millones de euros, con actividad internacional, al menos 3 años de existencia, y con sede social o actividad principal en España, si bien las inversiones podrán realizarse también en filiales extranjeras de dichas compañías. El C invertirá mayoritariamente en deuda senior (incluyendo la concesión de préstamos pero no inversión en préstamos), combinada con deuda subordinada, inversiones minoritarias en el capital de las compañías o en instrumentos similares. El C invertirá solo en mercado primario y no invertirá en bonos cotizados.

Operativa en instrumentos derivados

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

Divisa de denominación EUR

2. Datos económicos

2.1.a) Datos generales

Cuando no exista información disponible las correspondientes celdas aparecerán en blanco

Participaciones, partícipes y patrimonio

CLASE	Nº de participaciones a fin periodo	Nº de partícipes a fin periodo	Divisa	Beneficios brutos distribuidos por participación (periodo actual)	Inversión mínima	Distribuye dividendos	Patrimonio (en miles)			
							A final del periodo	Diciembre 2018	Diciembre 2017	Diciembre 2016
CLASE A	324.428,33	21	EUR	0,00	0	NO	3.751	3.845	3.623	2.462
CLASE B	453.873,89	2	EUR	0,00	100000	NO	5.328	5.459	5.136	3.489
CLASE C	908.926,57	2	EUR	0,00	100000	NO	10.832	11.090	10.420	7.111

Valor liquidativo (*)

CLASE	Divisa	Último valor liquidativo estimado		Último valor liquidativo definitivo			Valor liquidativo definitivo		
		Fecha	Importe	Fecha	Importe	Estimación que se realizó	2018	2017	2016
CLASE A	EUR			30-06-2019	11,5606		11,2523	10,6024	9,9224
CLASE B	EUR			30-06-2019	11,7383		11,4174	10,7427	10,0371
CLASE C	EUR			30-06-2019	11,9172		11,5836	10,8837	10,1518

Nota: En el caso de IIC cuyo valor liquidativo no se determine diariamente, los datos se refieren al último disponible.

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

Comisiones aplicadas en el período, sobre patrimonio medio

CLASE	Sist. Imputac.	Comisión de gestión						Comisión de depositario			
		% efectivamente cobrado						Base de cálculo	% efectivamente cobrado		Base de cálculo
		Periodo			Acumulada				Periodo	Acumulada	
		s/patrimonio	s/resultados	Total	s/patrimonio	s/resultados	Total				
CLASE A		0,13	0,00	0,13	0,13	0,00	0,13	patrimonio	0,04	0,04	Patrimonio
CLASE B		0,06	0,00	0,06	0,06	0,00	0,06	patrimonio	0,04	0,04	Patrimonio
CLASE C		0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	patrimonio	0,04	0,04	Patrimonio

El sistema de imputación de la comisión sobre resultados es

2.2 Comportamiento

Cuando no exista información disponible las correspondientes celdas aparecerán en blanco

CLASE A .Divisa EUR

Rentabilidad (% sin anualizar)

Acumulado 2019		Anual			
Con último VL estimado	Con último VL definitivo	2018	2017	2016	Año t-5
	2,74	6,13	6,85	4,29	

El último VL definitivo es de fecha: 30-06-2019

La periodicidad de cálculo del valor liquidativo es diaria

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

Medidas de riesgo (%)	Acumulado 2019	Trimestral				Anual			
		Último trim (0)	Trim-1	Trim-2	Trim-3	2018	2017	2016	Año t-5
Volatilidad(i) de:									
Valor liquidativo	2,36	2,66	2,03	2,86	2,97	3,07	4,36	2,95	
VaR histórico del valor liquidativo(ii)	3,54	3,54	3,65	3,78	3,92	3,78	4,46	5,60	
LETRA 1 AÑO	0,73	1,02	0,19	0,39	0,25	0,38	0,59	0,71	
VaR condicional del valor liquidativo(iii)	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	

(i) Volatilidad histórica: Indica el riesgo de un valor en un periodo, a mayor volatilidad mayor riesgo. A modo comparativo se ofrece la volatilidad de la Letra del Tesoro a 1 año o (del índice de referencia si existe en folleto). Sólo se informa de la volatilidad para los períodos con política de inversión homogénea.

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

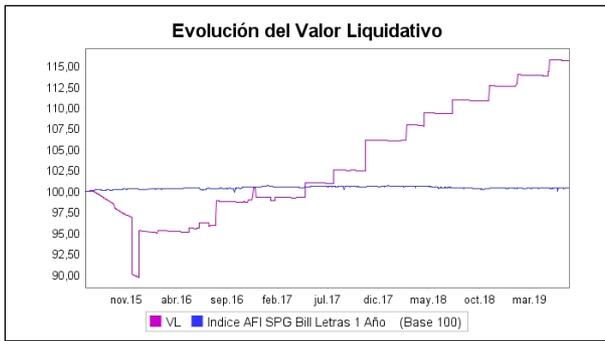
(iii) VaR condicional del valor liquidativo: Indica la pérdida media esperada en el resto de los casos.

Gastos (% s/ patrimonio medio)	Acumulado 2019	Anual			
		2018	2017	2016	Año t-5
Ratio total de gastos (iv)	0,83	0,51	0,76	0,77	

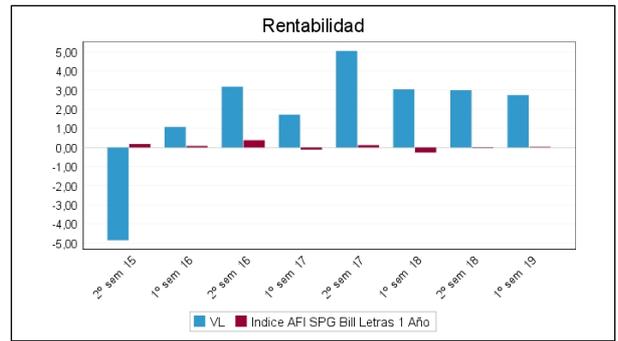
(iv) Incluye los gastos directos soportados en el periodo de referencia: comisión de gestión sobre patrimonio, comisión de depositario, auditoría, servicios bancarios (salvo gastos de financiación), y resto de gastos de gestión corriente, en términos de porcentaje sobre patrimonio medio del periodo.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

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

Evolución del valor liquidativo últimos 5 años



Rentabilidad semestral de los últimos 5 años



CLASE B .Divisa EUR

Rentabilidad (% sin anualizar)

Acumulado 2019		Anual			
Con último VL estimado	Con último VL definitivo	2018	2017	2016	Año t-5
	2,81	6,28	7,03	4,56	

El último VL definitivo es de fecha: 30-06-2019

La periodicidad de cálculo del valor liquidativo es diaria

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

Medidas de riesgo (%)	Acumulado 2019	Trimestral				Anual			
		Último trim (0)	Trim-1	Trim-2	Trim-3	2018	2017	2016	Año t-5
Volatilidad(i) de:									
Valor liquidativo	2,36	2,66	2,03	2,86	2,97	3,07	4,36	2,95	
VaR histórico del valor liquidativo(ii)	3,47	3,47	3,57	3,70	3,83	3,70	4,36	5,48	
LETRA 1 AÑO	0,73	1,02	0,19	0,39	0,25	0,38	0,59	0,71	
VaR condicional del valor liquidativo(iii)	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	

(i) Volatilidad histórica: Indica el riesgo de un valor en un periodo, a mayor volatilidad mayor riesgo. A modo comparativo se ofrece la volatilidad de la Letra del Tesoro a 1 año o (del índice de referencia si existe en folleto). Sólo se informa de la volatilidad para los períodos con política de inversión homogénea.

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

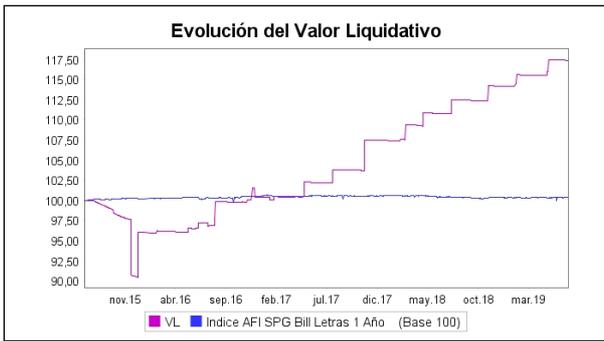
(iii) VaR condicional del valor liquidativo: Indica la pérdida media esperada en el resto de los casos.

Gastos (% s/ patrimonio medio)	Acumulado 2019	Anual			
		2018	2017	2016	Año t-5
Ratio total de gastos (iv)	0,76	0,36	0,49	0,52	

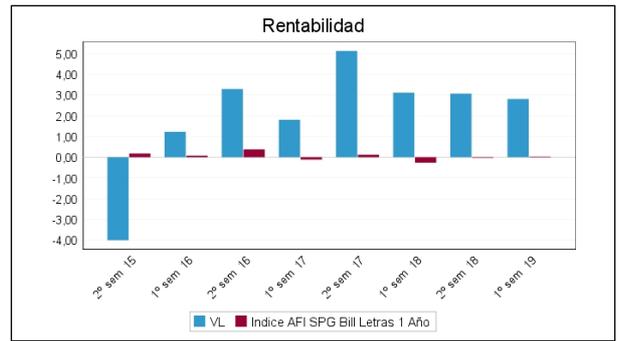
(iv) Incluye los gastos directos soportados en el periodo de referencia: comisión de gestión sobre patrimonio, comisión de depositario, auditoría, servicios bancarios (salvo gastos de financiación), y resto de gastos de gestión corriente, en términos de porcentaje sobre patrimonio medio del periodo.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

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

Evolución del valor liquidativo últimos 5 años



Rentabilidad semestral de los últimos 5 años



CLASE C .Divisa EUR

Rentabilidad (% sin anualizar)

Acumulado 2019		Anual			
Con último VL estimado	Con último VL definitivo	2018	2017	2016	Año t-5
	2,88	6,43	7,21	4,84	

El último VL definitivo es de fecha: 30-06-2019

La periodicidad de cálculo del valor liquidativo es diaria

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

Medidas de riesgo (%)	Acumulado 2019	Trimestral				Anual			
		Último trim (0)	Trim-1	Trim-2	Trim-3	2018	2017	2016	Año t-5
Volatilidad(i) de:									
Valor liquidativo	2,36	2,66	2,03	2,86	2,97	3,07	4,36	2,95	
VaR histórico del valor liquidativo(ii)	3,40	3,40	3,50	3,63	3,76	3,63	4,27	5,36	
LETRA 1 AÑO	0,73	1,02	0,19	0,39	0,25	0,38	0,59	0,71	
VaR condicional del valor liquidativo(iii)	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	

(i) Volatilidad histórica: Indica el riesgo de un valor en un periodo, a mayor volatilidad mayor riesgo. A modo comparativo se ofrece la volatilidad de la Letra del Tesoro a 1 año o (del índice de referencia si existe en folleto). Sólo se informa de la volatilidad para los períodos con política de inversión homogénea.

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

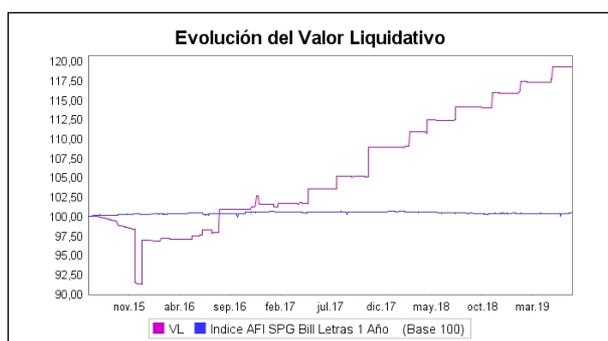
(iii) VaR condicional del valor liquidativo: Indica la pérdida media esperada en el resto de los casos.

Gastos (% s/ patrimonio medio)	Acumulado 2019	Anual			
		2018	2017	2016	Año t-5
Ratio total de gastos (iv)	0,70	0,21	0,29	0,29	

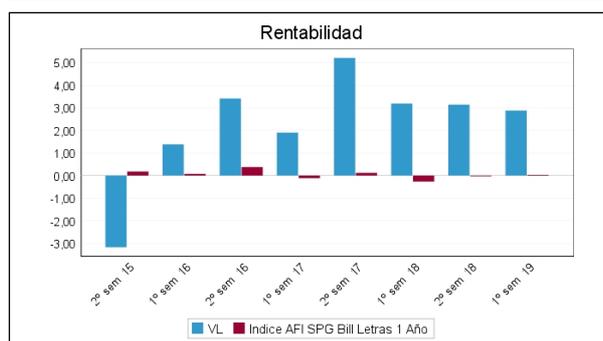
(iv) Incluye los gastos directos soportados en el periodo de referencia: comisión de gestión sobre patrimonio, comisión de depositario, auditoría, servicios bancarios (salvo gastos de financiación), y resto de gastos de gestión corriente, en términos de porcentaje sobre patrimonio medio del periodo.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

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

Evolución del valor liquidativo últimos 5 años



Rentabilidad semestral de los últimos 5 años



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

Distribución del patrimonio	Fin periodo actual		Fin periodo anterior	
	Importe	% sobre patrimonio	Importe	% sobre patrimonio
(+) INVERSIONES FINANCIERAS	17.860	89,69	17.710	86,84
* Cartera interior	0	0,00	0	0,00
* Cartera exterior	17.860	89,69	17.710	86,84
* Intereses de la cartera de inversión	0	0,00	0	0,00
* Inversiones dudosas, morosas o en litigio	0	0,00	0	0,00
(+) LIQUIDEZ (TESORERÍA)	2.082	10,46	2.711	13,29
(+/-) RESTO	-29	-0,15	-27	-0,13
TOTAL PATRIMONIO	19.912	100,00 %	20.395	100,00 %

Notas:

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

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

2.4 Estado de variación patrimonial

	% sobre patrimonio medio			% variación respecto fin periodo anterior
	Variación del período actual	Variación del período anterior	Variación acumulada anual	
PATRIMONIO FIN PERIODO ANTERIOR (miles de EUR)	20.395	19.782	20.979	
± Suscripciones/ reembolsos (neto)	-5,16	0,00	-5,16	0,00
- Beneficios brutos distribuidos	0,00	0,00	0,00	0,00
± Rendimientos netos	2,82	3,04	2,82	-5,19
(+) Rendimientos de gestión	2,99	3,21	2,99	-4,93
(-) Gastos repercutidos	0,18	0,18	0,18	-0,58
- Comisión de gestión	0,04	0,05	0,04	-1,63
- Gastos de financiación	0,00	0,00	0,00	0,00
- Otros gastos repercutidos	0,13	0,13	0,13	-0,23
(+) Ingresos	0,00	0,00	0,00	0,00
PATRIMONIO FIN PERIODO ACTUAL (miles de EUR)	19.912	20.395	19.912	

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

3. Inversiones financieras

No existen inversiones

4. Hechos relevantes

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

5. Anexo explicativo de hechos relevantes

No aplicable.

6. Operaciones vinculadas y otras informaciones

	SI	NO
a. Partícipes significativos en el patrimonio del fondo (porcentaje superior al 20%)	X	
b. Modificaciones de escasa relevancia en el Reglamento		X
c. Gestora y el depositario son del mismo grupo (según artículo 4 de la LMV)		X
d. Se han realizado operaciones de adquisición y venta de valores en los que el depositario ha actuado como vendedor o comprador, respectivamente		X
e. Se han adquirido valores o instrumentos financieros emitidos o avalados por alguna entidad del grupo de la gestora o depositario, o alguno de éstos ha actuado de colocador, asegurador, director o asesor o se han prestado valores a entidades vinculadas.		X
f. Se han adquirido valores o instrumentos financieros cuya contrapartida ha sido una entidad del grupo de la gestora o depositario u otra IIC gestionada por la misma gestora u otra gestora del grupo.		X
g. Se han percibido ingresos por entidades del grupo de la gestora que tienen como origen comisiones o gastos satisfechos por la IIC.		X
h. Diferencias superiores al 10% entre valor liquidativo estimado y el definitivo a la misma fecha		X
i. Se ha ejercido el derecho de disposición sobre garantías otorgadas (sólo aplicable a FIL)		X
j. Otras informaciones u operaciones vinculadas		X

	Al final del periodo
k. % endeudamiento medio del periodo	0,00
l. % patrimonio afectado por operaciones estructuradas de terceros en las que la IIC actúe como subyacente.	0,00
m. % patrimonio vinculado a posiciones propias del personal de la sociedad gestora o de los promotores	0,00

7. Anexo explicativo sobre operaciones vinculadas y otras informaciones

A) El fondo tiene dos partícipes significativos, que mantienen una posición de 27,20 % y 27,21%.

8. Información y advertencias a instancia de la CNMV

No aplicable.

9. Anexo explicativo del informe periódico

Asume la responsabilidad del informe: Jacobo Llanza Figueroa, Consejero Delegado de Alantra Asset Management, S.G.I.I.C, S.A.

El segundo trimestre del año 2019 continúa dando muestras de desaceleración de la economía mundial, aún en mayor medida que el primer trimestre del año. Dicha disminución de la actividad económica es dispar entre diferentes países y zonas geográficas.

Europa sigue siendo una de las regiones más amenazadas por la desaceleración global, Estados Unidos continúa su tendencia de crecimiento económico, a pesar de la guerra comercial con China, país donde ya se empieza a notar algunos síntomas de ralentización. En otros países emergentes, el crecimiento es mayor, aunque en las perspectivas a futuro también se espera cierta desaceleración económica a medio plazo

El Fondo Monetario Internacional ("FMI") ha estimado el crecimiento mundial para el año 2019 en un 3,2%, es decir, -0,1 p.p respecto al esperado en abril de 2019. La previsión para el año 2020 se ha rebajado respecto al trimestre anterior en -0,1 p.p, situándose en el 3,5%.

Los principales factores que ralentizan la economía global son:

- Prolongación de las tensiones comerciales entre Estados Unidos y China, que están provocando reducciones en los niveles de comercio internacional y poniendo en duda la sostenibilidad de la fase expansiva de la economía global.
- Posibilidad existente de un Brexit sin acuerdo ha cobrado fuerza, sobre todo tras la dimisión de la Primer Ministro y el nombramiento de Boris Johnson.
- Debilidad de la zona euro debido a la contracción de las ventas al exterior, con la reducción en los niveles de actividad de los sectores manufactureros y automovilísticos como consecuencia de la desaceleración del comercio internacional (-0,3% respecto al trimestre anterior) y la escalada de las medidas proteccionistas.
- Las economías emergentes están viéndose afectadas por las "guerras comerciales" y por el aumento de la aversión al riesgo.

En respuesta, los diferentes bancos centrales se están alineando hacia medidas aún más acomodativas en sus políticas monetarias. Estados Unidos a través de la Reserva Federal, apunta a una bajada de los tipos de interés a corto plazo, poniendo fin al ciclo de tensionamiento de la política monetaria emprendida en el año 2015. Por otra parte, el Consejo de Gobierno del Banco Central Europeo anunció que los tipos de interés oficiales permanecerán en los niveles actuales, al menos hasta el primer semestre de 2020, con el objetivo de alcanzar el objetivo de inflación.

En la zona euro la actividad económica está viéndose especialmente afectada, debido al impacto del proteccionismo en industrias clave como la automovilística, así como a las incertidumbres políticas (Brexit, Alemania, gobierno en España e Italia, etc.). El Eurosistema ha revisado a la baja las proyecciones de crecimiento hasta el 1,3% y 1,6% para 2019 y 2020 respectivamente.

La economía española será uno de los motores de la zona euro, pese a las incertidumbres políticas y la situación económica global (impactando en las exportaciones). Según el Banco de España, nuestro país creció en el segundo trimestre de 2019 un 0,6%, es decir, 0,1 p.p. menos respecto al primer trimestre del año (0,7%). Los últimos datos también muestran una disminución en los niveles de creación de empleo, como consecuencia de la ralentización en los niveles de actividad. Paralelamente, las afiliaciones a la Seguridad Social perdieron fuerza en mayo.

La previsión a futuro del Banco de España es una continuación del periodo expansivo de la economía, principalmente impulsado por la demanda interna como consecuencia de la mejora en la situación económica de las familias y las condiciones favorables de acceso al crédito (si bien se están observando las primeras tendencias de contención en este aspecto). Todo ello a pesar de las dudas acerca de la constitución de un Gobierno en España con firme respaldo del Parlamento que permita atajar con contundencia los problemas estructurales de la economía nacional.

Por otra parte, la evolución de la inflación sigue sin notar el aumento de las presiones del repunte de los costes laborales y la sostenida pujanza de la demanda. La inflación se situó en el 1,3% (vs. 1,1% del primer trimestre 2019), mientras que el índice normalizado (eliminando el efecto del petróleo y de los alimentos no procesados) se sitúa en niveles del 1,2% (vs. 0,8% del primer trimestre del año 2019).

Durante el primer semestre de 2019 no se ha realizado ninguna inversión adicional en la cartera de Alteralia. Por tanto, la cartera de inversión a 30 de junio estaba compuesta por 11 inversiones (15 operaciones completadas, de las que 4 han

sido totalmente desinvertidas), todas ellas instrumentalizadas a través de productos de financiación directa a compañías españolas de tamaño mediano para favorecer su internacionalización.

No existen a la fecha del informe posiciones de derivados ni operaciones a plazo con la finalidad de cobertura, siempre dentro de los límites establecidos, y teniendo la finalidad de minimizar los riesgos inherentes a las inversiones realizadas.

En el periodo a que se refiere el informe, el patrimonio de la IIC ha disminuido en un 2.38%, el número de partícipes no ha variado y la rentabilidad de la IIC ha sido de un 2.84%.

La cartera de la IIC muestra un VAR a dos semanas con un 95% de confianza del 2.27%.

El detalle de los gastos que soporta la IIC en el período son:

Comisión de gestión:

Clase A: 0.13%

Clase B: 0.06%

Clase C: 0.00%

Comisión de depositaría:

Clase A: 0.04%

Clase B: 0.04%

Clase C: 0.04%

Gastos Indirectos:

Clase A: 0.66%

Clase B: 0.66%

Clase C: 0.66%

Total ratio de gastos:

Clase A: 0.83%

Clase B: 0.76%

Clase C: 0.70%

Rentabilidad de la IIC:

Clase A: 2.74%

Clase B: 2.81%

Clase C: 2.88%

Rentabilidad Bruta del periodo:

Clase A: 3.57%

Clase B: 3.57%

Clase C: 3.58%

La tesorería de la Sociedad está invertida al MIBOR mensual menos 1 punto. La Sociedad se valora de acuerdo con los criterios recogidos en la circular 3/2008 de 11 de septiembre de la CNMV.

Con carácter general, Alantra Asset Management SGIIC, S.A. ejerce los derechos de asistencia y voto en las juntas generales de las sociedades participadas por sus fondos, ya sea de manera favorable a las propuestas realizadas por los Consejos de Administración de dichas sociedades o en el sentido que considere en mejor interés de tales fondos y sus partícipes. Alantra Asset Management SGIIC, S.A. ejercerá, en todo caso, los derechos de asistencia y voto en las juntas generales de accionistas de las sociedades españolas en las que sus fondos bajo gestión mantengan con más de un año de antigüedad, una participación superior al 1% del capital social de la compañía.

10. Información sobre la política de remuneración

No existe información sobre política de remuneración

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

No existe información sobre operaciones de financiación de valores, reutilización de las garantías y swaps de rendimiento total