

# CAIXABANK BOLSA INDICE EURO, FI

Informe Segon semestre 2022

Núm. registre CNMV: 0032

Data de registre: 25/11/1986

Gestora: CaixaBank Asset Management SGIC, S.A.

Dipositari: CECABANK SA

Grup Gestora/Dipositari: / CECA

Ràting Dipositari: BBB+

Auditor: DELOITTE

Aquest informe, juntament amb els últims informes periòdics, estan disponibles per mitjans telemàtics a [www.caixabank.es](http://www.caixabank.es) o [www.caixabankassetmanagement.com](http://www.caixabankassetmanagement.com)

L'entitat gestora atén les consultes dels clients, relacionades amb les IIC gestionades a P<sup>o</sup> de la Castellana 51, 5<sup>a</sup> pl. 28046 Madrid, correu electrònic per mitjà de formulari disponible a [www.caixabank.es](http://www.caixabank.es)

A més disposa d'un departament o servei d'atenció al client encarregat de resoldre les queixes i reclamacions. Igualment, la CNMV posa a la seva disposició l'Oficina d'Atenció a l'Inversor (902 149 200, correu electrònic: [inversores@cnmv.es](mailto:inversores@cnmv.es)).

## 1. POLÍTICA D'INVERSIÓ I DIVISA DE DENOMINACIÓ

**CATEGORIA:** Tipus de fons: Fons que reproduïx un índex; Vocació inversora: IIC que replica un índex; Perfil de risc: 6 (En una escala del 1 al 7)

**DESCRIPCIÓ GENERAL:** Fons de renda variable que replica o reproduïx l'índex borsari Eurostoxx-50 ESG Net Return.

**OPERACIONS EN INSTRUMENTS DERIVATS:** El fons ha dut a terme operacions amb instruments derivats amb la finalitat d'inversió per gestionar d'una manera més eficaç la cartera. La metodologia aplicada per a calcular l'exposició total al risc de mercat és el mètode del compromís. Una informació més detallada sobre la política d'inversió del fons es pot trobar en el seu fullet informatiu.

**DIVISA DE DENOMINACIÓ:** EUR

## 2. DADES ECONÒMIQUES

### 2.1. DADES GENERALS

	Període actual	Període anterior	Any actual	Any anterior
Índex de rotació de la cartera	0,14	0,09	0,23	0,53
Rendibilitat mitjana de la liquiditat (% anualitzat)	0,62	-0,13	0,25	-0,12

Nota: El període es refereix al trimestre o semestre, segons el cas. En el cas d'IIC el valor liquidatiu no es determini diàriament, les dades es refereixen a l'últim disponible.

#### CAIXABANK BOLSA INDICE EURO, FI CLASE ESTANDAR

	Període actual	Període anterior	Data	Patrimoni (milers d'euros)	Valor liquidatiu (euros)	Comissions aplicades en el període, sobre patrimoni mitjà	% cobrat efectivament		Base de càlcul
							Període	Acumulada	
Nre. de participacions	2.725.162,58	2.378.211,27	Període	105.016	38.5355	Comissió de gestió	0,50	1,00	Patrimoni
Nº de participacions	9.332	8.496	2021	106.325	43.0089	Comissió de resultats	0,00	0,00	Resultats
Benef. bruts distrib. per particip. (Euros)	0,00	0,00	2020	97.726	34.9352	Comissió de gestió total	0,50	1,00	Mixta
			2019	121.029	36.3414	Comissió de dipositari	0,01	0,02	Patrimoni

Inversió mínima: 6 EUR

#### CAIXABANK BOLSA INDICE EURO, FI C INSTITUC PLUS

	Període actual	Període anterior	Data	Patrimoni (milers d'euros)	Valor liquidatiu (euros)	Comissions aplicades en el període, sobre patrimoni mitjà	% cobrat efectivament		Base de càlcul
							Període	Acumulada	
Nre. de participacions	5.817.315,53	5.750.631,49	Període	255.503	43.9211	Comissió de gestió	0,05	0,09	Patrimoni
Nº de participacions	2	2	2021	279.245	48.5589	Comissió de resultats	0,00	0,00	Resultats
Benef. bruts distrib. per particip. (Euros)	0,00	0,00	2020	266.638	39.0753	Comissió de gestió total	0,05	0,09	Mixta
			2019	291.102	40.2730	Comissió de dipositari	0,01	0,02	Patrimoni

Inversió mínima: 50000000 EUR

#### CAIXABANK BOLSA INDICE EURO, FI CLASE CARTERA

	Període actual	Període anterior	Data	Patrimoni (milers d'euros)	Valor liquidatiu (euros)	Comissions aplicades en el període, sobre patrimoni mitjà	% cobrat efectivament		Base de càlcul
							Període	Acumulada	
Nre. de participacions	1.138.174,95	1.905.698,75	Període	9.645	8.4741	Comissió de gestió	0,05	0,09	Patrimoni
Nº de participacions	46	7	2021	17.787	9.3689	Comissió de resultats	0,00	0,00	Resultats
Benef. bruts distrib. per particip. (Euros)	0,00	0,00	2020	861	7.5391	Comissió de gestió total	0,05	0,09	Mixta
			2019			Comissió de dipositari	0,01	0,02	Patrimoni

Inversió mínima:

#### CAIXABANK BOLSA INDICE EURO, FI CLASE EXTRA

	Període actual	Període anterior	Data	Patrimoni (milers d'euros)	Valor liquidatiu (euros)	Comissions aplicades en el període, sobre patrimoni mitjà	% cobrat efectivament		Base de càlcul
							Període	Acumulada	
Nre. de participacions	1.876.015,40	1.276.437,24	Període	15.332	8.1726	Comissió de gestió	0,38	0,75	Patrimoni
Nº de participacions	66	48	2021	12.655	9.0985	Comissió de resultats	0,00	0,00	Resultats
Benef. bruts distrib. per particip. (Euros)	0,00	0,00	2020	9.621	7.3721	Comissió de gestió total	0,38	0,75	Mixta
			2019			Comissió de dipositari	0,01	0,02	Patrimoni

Inversió mínima: 150000 EUR

### 2.2. COMPORTAMENT

#### 2.2.1. Individual - CAIXABANK BOLSA INDICE EURO, FI. Divisa EUR Rendibilitat (% anualitzat)

**CAIXABANK BOLSA INDICE EURO, FI CLASE ESTANDAR**

	Acumulat any actual	Trimestral				Anual			
		31-12-22	30-09-22	30-06-22	31-03-22	2021	2020	2019	2017
Rendibilitat	-10,40	13,77	-4,04	-9,67	-9,15				
		Trimestre actual		Últim any		Últims 3 anys			
<b>Rendibilitats extremes*</b>		%	Data	%	Data	%	Data		
Rendibilitat mínima (%)		-3,47	15-12-22	-4,81	04-03-22	--			
Rendibilitat màxima (%)		4,10	04-10-22	7,19	09-03-22	--			

**CAIXABANK BOLSA INDICE EURO, FI C INSTITUC PLUS**

	Acumulat any actual	Trimestral				Anual			
		31-12-22	30-09-22	30-06-22	31-03-22	2021	2020	2019	2017
Rendibilitat	-9,55	14,04	-3,81	-9,45	-8,94				
		Trimestre actual		Últim any		Últims 3 anys			
<b>Rendibilitats extremes*</b>		%	Data	%	Data	%	Data		
Rendibilitat mínima (%)		-3,46	15-12-22	-4,81	04-03-22	--			
Rendibilitat màxima (%)		4,11	04-10-22	7,19	09-03-22	--			

**CAIXABANK BOLSA INDICE EURO, FI CLASE CARTERA**

	Acumulat any actual	Trimestral				Anual			
		31-12-22	30-09-22	30-06-22	31-03-22	2021	2020	2019	2017
Rendibilitat	-9,55	14,04	-3,80	-9,45	-8,94				
		Trimestre actual		Últim any		Últims 3 anys			
<b>Rendibilitats extremes*</b>		%	Data	%	Data	%	Data		
Rendibilitat mínima (%)		-3,46	15-12-22	-4,81	04-03-22	--			
Rendibilitat màxima (%)		4,11	04-10-22	7,19	09-03-22	--			

**CAIXABANK BOLSA INDICE EURO, FI CLASE EXTRA**

	Acumulat any actual	Trimestral				Anual			
		31-12-22	30-09-22	30-06-22	31-03-22	2021	2020	2019	2017
Rendibilitat	-10,18	13,84	-3,97	-9,61	-9,10				
		Trimestre actual		Últim any		Últims 3 anys			
<b>Rendibilitats extremes*</b>		%	Data	%	Data	%	Data		
Rendibilitat mínima (%)		-3,47	15-12-22	-4,81	04-03-22	--			
Rendibilitat màxima (%)		4,11	04-10-22	7,19	09-03-22	--			

\* Només se n'informa per a les classes amb una antiguitat mínima del període sol·licitat i sempre que no s'hagi modificat la vocació inversora. Fa referència a les rendibilitats màximes i mínimes entre dos valors liquidatius consecutius.  
La periodicitat de càlcul del valor liquidatiu és diària.

Recordi que rendibilitats passades no pressuposen rendibilitats futures. Només se n'informa si s'ha mantingut una política d'inversió homogènia en el període.

**Mesures de risc (%)**

	Acumulat any actual	Trimestral				Anual			
		31-12-22	30-09-22	30-06-22	31-03-22	2021	2020	2019	2017
<b>Volatilitat * de:</b>									
Ibex-35 Net TR	19,30	15,21	16,39	19,91	24,93				
Letra Tesoro 1 año	0,07	0,02	0,03	0,03	0,02				
100% Euro Stoxx 50 ESG Net Return (SX5TESG)	22,79	17,77	19,01	23,06	30,05				

**CAIXABANK BOLSA INDICE EURO, FI CLASE ESTANDAR**

	Acumulat any actual	Trimestral				Anual			
		31-12-22	30-09-22	30-06-22	31-03-22	2021	2020	2019	2017
<b>Volatilitat * de:</b>									
Valor Liquidatiu	23,12	18,02	19,37	23,05	30,29				
VaR històric **	9,08	9,08	0,00	0,00	0,00				

**CAIXABANK BOLSA INDICE EURO, FI C INSTITUC PLUS**

	Acumulat any actual	Trimestral				Anual			
		31-12-22	30-09-22	30-06-22	31-03-22	2021	2020	2019	2017
<b>Volatilitat * de:</b>									
Valor Liquidatiu	23,12	18,02	19,37	23,05	30,29				
VaR històric **	9,00	9,00	0,00	0,00	0,00				

**CAIXABANK BOLSA INDICE EURO, FI CLASE CARTERA**

	Acumulat any actual	Trimestral				Anual			
		31-12-22	30-09-22	30-06-22	31-03-22	2021	2020	2019	2017
<b>Volatilitat * de:</b>									
Valor Liquidatiu	23,12	18,02	19,37	23,05	30,29				
VaR històric **	9,00	9,00	0,00	0,00	0,00				

**CAIXABANK BOLSA INDICE EURO, FI CLASE EXTRA**

	Acumulat any actual	Trimestral				Anual			
		31-12-22	30-09-22	30-06-22	31-03-22	2021	2020	2019	2017
<b>Volatilitat * de:</b>									
Valor Liquidatiu	23,12	18,02	19,37	23,05	30,29				
VaR històric **	9,06	9,06	0,00	0,00	0,00				

\* Volatilitat històrica: indica el risc d'un valor en un període, a més volatilitat més risc. Per poder comparar s'ofereix la volatilitat de diferents referències. Només s'informa de la volatilitat per als períodes amb política d'inversió homogènia.

\*\* VaR històric: indica el màxim que es pot perdre, amb un nivell de confiança del 99%, en el termini d'1 mes, si es repeteix el comportament de la IIC dels últims 5 anys. La dada és a finals del període de referència.

### Despeses (% s/ patrimoni mitjà)

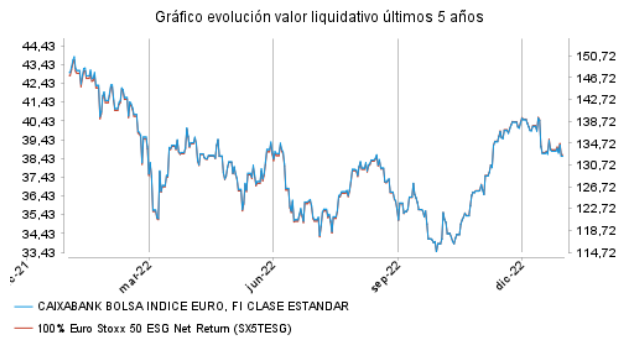
#### CAIXABANK BOLSA INDICE EURO, FI

Ràtio total de despeses *	Acumulat any actual	Trimestral				Anual			
		31-12-22	30-09-22	30-06-22	31-03-22	2021	2020	2019	2017
CLASE ESTANDAR	1,06	0,27	0,27	0,26	0,26	1,06	1,05	1,41	2,13
CAIXABANK BOLSA INDICE EURO, FI C INSTITUC PLUS	0,15	0,04	0,04	0,04	0,04	0,15	0,15	0,14	0,14
CLASE CARTERA	0,15	0,04	0,04	0,04	0,04	0,15	0,11		
CLASE EXTRA	0,81	0,20	0,20	0,20	0,20	0,81	0,61		

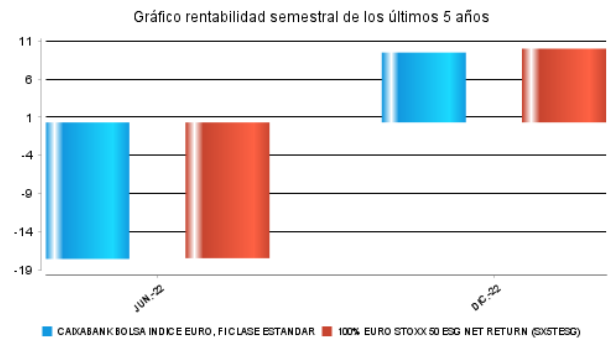
\* Inclou totes les despeses directes que hi ha hagut en el període de referència: comissió de gestió sobre patrimoni, comissió de dipositar, auditoria, serveis bancaris (excepte despeses de finançament) i la resta de despeses de gestió corrent, en termes de tant per cent sobre el patrimoni mitjà del període. En cas de fons/compartiments que inverteixen més d'un 10% del patrimoni en altres IIC s'inclouen també les despeses efectuades indirectament, derivades d'aquestes inversions, que inclouen les comissions de subscripció i de reemborsament. Aquest ràtio no inclou la comissió de gestió sobre resultats ni els costos per la compravenda de valors.

#### Evolució del valor liquidatiu darrers 5 anys

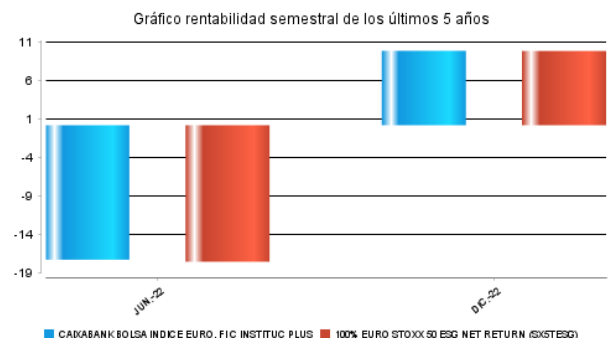
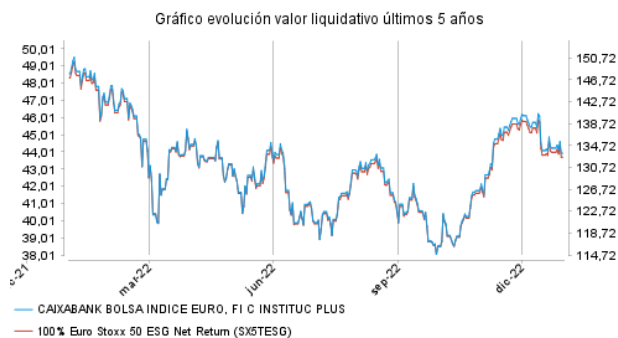
##### CAIXABANK BOLSA INDICE EURO, FI CLASE ESTANDAR



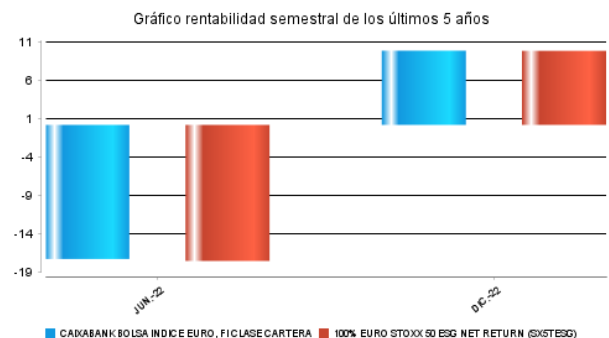
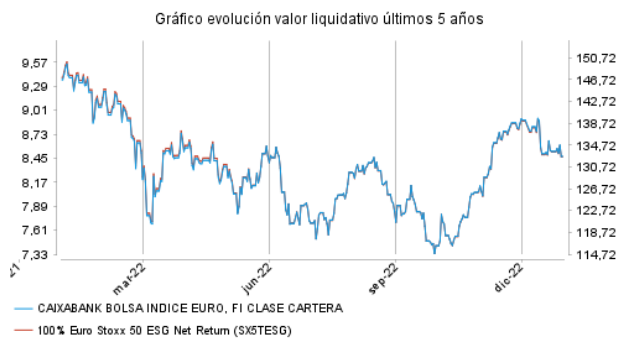
#### Rendibilitat semestral dels últims 5 anys



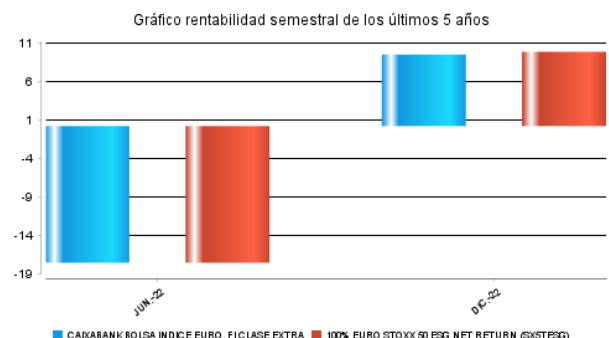
##### CAIXABANK BOLSA INDICE EURO, FI C INSTITUC PLUS



##### CAIXABANK BOLSA INDICE EURO, FI CLASE CARTERA



##### CAIXABANK BOLSA INDICE EURO, FI CLASE EXTRA



## 2.2.2. Comparativa

Durant el període de referència, la rendibilitat mitjana en el període de referència dels fons gestionats per la societat gestora es presenta en el quadre adjunt. Els fons s'agrupen segons la vocació inversora.

Vocació inversora	Patrimoni gestionat* (milers d'euros)	Nº de particips*	Rendibilitat semestral mitjana**
Renda fixa euro	20.995.852	1.830.808	-3,02
Renda fixa internacional	2.881.948	628.188	-4,49
Renda fixa mixta euro	2.290.240	83.514	-2,46
Renda fixa mixta internacional	6.256.052	197.253	-1,18
Renda variable mixta euro	85.832	5.042	2,54
Renda variable mixta internacional	2.817.134	107.832	-2,36
Renda variable euro	603.167	280.561	2,76
Renda variable internacional	14.968.061	2.197.252	0,15
IIC de gestió passiva (I)	0	0	0,00
Garantit de rendiment fix	327.832	13.103	-2,45
Garantit de rendiment variable	676.993	32.968	-1,12
De garantia parcial	0	0	0,00
Retorn absolut	3.350.917	442.070	0,19
Global	7.372.564	253.439	-1,03
FMM a curt termini de valor liquidatiu variable	0	0	0,00
FMM a curt termini de valor liquidatiu constant de deute publica	0	0	0,00
FMM a curt termini de valor liquidatiu de baixa volatilitat	0	0	0,00
FMM estàndard de valor liquidatiu variable	4.506.933	99.522	-0,07
Renda fixa euro curt termini	4.183.965	506.107	-0,15
IIC que replica un índex	1.019.761	20.401	4,22
IIC amb objectiu concret de rendibilitat no garantit	1.038.651	40.359	0,12
<b>Total Fons</b>	<b>73.375.902</b>	<b>6.738.419</b>	<b>-1,32</b>

\*Mitjanes.

(I): inclou IIC que reproduïen un índex, fons cotitzats (ETF) i IIC amb objectiu concret de rendibilitat no garantit.

\*\* Rendibilitat mitjana ponderada per patrimoni mitjà de cada FI en el període

## 2.3. DISTRIBUCIÓ DEL PATRIMONI AL TANCAMENT DEL PERÍODE (IMPORTS EN MILERS D'EUROS)

Distribució del patrimoni	Fi període actual		Fin període anterior	
	Import	% sobre patrimoni	Import	% sobre patrimoni
(+) INVERSIONS FINANCERES	365.967	94,93	323.515.339	95,59
* Cartera interior	21.778	5,65	22.979.784	6,79
* Cartera exterior	344.189	89,28	300.535.555	88,80
* Interessos cartera inversió	0	0,00	0	0,00
* Inversions dubtoses, moroses o en litigi	0	0,00	0	0,00
(+) LIQUIDITAT (TRESORERIA)	12.379	3,21	9.093.272	2,69
(+/-) RESTA	7.149	1,85	5.828.757	1,72
<b>TOTAL PATRIMONI</b>	<b>385.495</b>	<b>100,00</b>	<b>338.437.368</b>	<b>100,00</b>

Notes:

El període fa referència al trimestre o semestre, segons el cas.

Les inversions financeres s'indiquen a valor estimat de realització.

## 2.4. ESTAT DE VARIACIÓ PATRIMONIAL

PATRIMONI FI PERÍODE ANTERIOR (milers d'euros)	% sobre patrimonio medio			
	Variació del període actual	Variació del període anterior	Variació acumulada anual	% Variació respecte fi període anterior
<b>PATRIMONI FI PERÍODE ANTERIOR (milers d'euros)</b>	<b>338.437</b>	<b>416.011.624</b>	<b>416.011.625</b>	
± Subscripcions/ reemborsaments (net)	3,72	-1,17	2,43	-402,66
Beneficis bruts distribuïts	0,00	0,00	0,00	0,00
± Rendiments nets	9,38	-19,42	-10,73	-146,08
(+) Rendiments de gestió	9,62	-19,05	-10,12	0,00
+ Interessos	0,01	0,00	0,00	-292,71
+ Dividends	0,76	2,58	3,39	-71,80
± Resultats en renda fixa (fetes o no)	0,00	0,00	0,00	-140,05
± Resultats en renda variable (fetes o no)	8,36	-20,79	-13,12	-138,37
± Resultat en dipòsits (fetes o no)	0,00	0,00	0,00	0,00
± Resultat en derivats (fetes o no)	0,49	-0,84	-0,39	-155,19
± Resultat en IIC (fetes o no)	0,00	0,00	0,00	0,00
± Altres resultats	0,00	0,00	0,00	0,00
± Altres rendiments	0,00	0,00	0,00	0,00
(-) Despeses repercutides	-0,24	-0,37	-0,61	-39,32
- Comissió de gestió	-0,18	-0,17	-0,34	-1,22
- Comissió de dipositar	-0,01	-0,01	-0,02	-3,02
- Despeses per serveis exteriors	-0,02	-0,02	-0,04	-17,78
- Altres despeses de gestió corrent	0,00	0,00	0,00	59,27
- Altres despeses repercutides	-0,03	-0,17	-0,21	-82,26
(+) Ingressos	0,00	0,00	0,00	0,00
+ Comissions de descompte a favor de la IIC	0,00	0,00	0,00	0,00
+ Comissions retrocedides	0,00	0,00	0,00	0,00
+ Altres ingressos	0,00	0,00	0,00	0,00
<b>PATRIMONI FI PERÍODE ACTUAL (milers d'euros)</b>	<b>385.495.203</b>	<b>338.437.368</b>	<b>385.495.203</b>	

Nota: el període fa referència al trimestre o semestre, segons el cas.

### 3. INVERSIONS FINANCERES

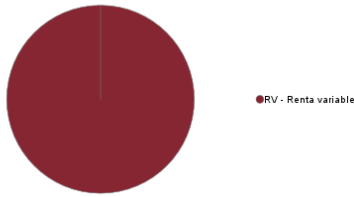
#### 3.1. INVERSIONS FINANCERES A VALOR ESTIMAT DE REALITZACIÓ (EN MILERS D'EUROS) AL TANCAMENT DEL PERÍODE

Descripció de la inversió i emissor	Divisa	Període actual		Període anterior	
		Valor de mercat	%	Valor de mercat	%
ACCIONES BBVA	EUR	3.656	0,95	4.141	1,22
ACCIONES BSAN	EUR	8.319	2,16	7.126	2,11
ACCIONES IBERDROLA	EUR	6.832	1,77	8.886	2,63
ACCIONES INDITEX	EUR	2.972	0,77	2.826	0,83
<b>TOTAL RV COTITZADA</b>		<b>21.778</b>	<b>5,65</b>	<b>22.980</b>	<b>6,79</b>
<b>TOTAL RENDA VARIABLE</b>		<b>21.778</b>	<b>5,65</b>	<b>22.980</b>	<b>6,79</b>
<b>TOTAL INVERSIONS FINANCERES INTERIOR</b>		<b>21.778</b>	<b>5,65</b>	<b>22.980</b>	<b>6,79</b>
ACCIONES MERCK	EUR	2.516	0,65	2.357	0,70
ACCIONES DAIMLER AG	EUR	5.195	1,35	4.963	1,47
ACCIONES SAP	EUR	10.614	2,75	10.858	3,21
ACCIONES SIEMENS	EUR	10.308	2,67	8.360	2,47
ACCIONES VOLKSWAGEN	EUR	2.583	0,67	0	0,00
ACCIONES ALLIANZ	EUR	14.321	3,71	11.437	3,38
ACCIONES MUENCHENER R.	EUR	7.527	1,95	4.846	1,43
ACCIONES ADIDAS-SALOMON	EUR	2.259	0,59	3.422	1,01
ACCIONES VONOVIA SE	EUR	2.754	0,71	3.236	0,96
ACCIONES BASF	EUR	0	0,00	4.339	1,28
ACCIONES BAYER	EUR	5.109	1,33	6.412	1,89
ACCIONES SYMRISE AG	EUR	2.385	0,62	0	0,00
ACCIONES NOKIA	EUR	4.126	1,07	0	0,00
ACCIONES KONE OYJ	EUR	2.089	0,54	2.186	0,65
ACCIONES NORDBANKEN ABP	EUR	6.516	1,69	0	0,00
ACCIONES TELEPERFORMANCE	EUR	0	0,00	2.067	0,61
ACCIONES HERMES INTERNAT	EUR	5.484	1,42	4.287	1,27
ACCIONES AIRLIQUIDE	EUR	7.457	1,93	7.687	2,27
ACCIONES CARREFOUR	EUR	0	0,00	1.209	0,36
ACCIONES TOTAL FINA	EUR	27.150	7,04	20.426	6,04
ACCIONES LOREAL	EUR	14.351	3,72	12.350	3,65
ACCIONES SANOFI	EUR	11.110	2,88	12.710	3,76
ACCIONES AXA	EUR	9.158	2,38	6.627	1,96
ACCIONES DANONE	EUR	3.387	0,88	4.078	1,20
ACCIONES PERNOD	EUR	3.967	1,03	4.134	1,22
ACCIONES LVMH MOET HENNE	EUR	19.094	4,95	17.484	5,17
ACCIONES SODEXHO	EUR	813	0,21	0	0,00
ACCIONES KERING	EUR	6.114	1,59	5.446	1,61
ACCIONES SCHNEIDER	EUR	13.194	3,42	9.995	2,95
ACCIONES VINCI	EUR	5.659	1,47	5.491	1,62
ACCIONES BNP	EUR	10.708	2,78	7.955	2,35
ACCIONES LEGRAND	EUR	3.528	0,92	2.961	0,87
ACCIONES MICHELIN	EUR	0	0,00	2.762	0,82
ACCIONES CRH	EUR	3.083	0,80	3.055	0,90
ACCIONES RYANAIR HOLDING	EUR	0	0,00	727	0,21
ACCIONES LINDE PLC	EUR	26.600	6,90	21.269	6,28
ACCIONES INTESA SANPAOLO	EUR	6.185	1,60	4.965	1,47
ACCIONES ENI	EUR	5.819	1,51	4.441	1,31
ACCIONES TERNA	EUR	1.720	0,45	1.694	0,50
ACCIONES PHILLIPS	EUR	0	0,00	2.844	0,84
ACCIONES KKN	EUR	2.150	0,56	2.605	0,77
ACCIONES ASML HOLDING NV	EUR	33.447	8,68	28.619	8,46
ACCIONES CNH INDUSTRIAL	EUR	1.583	0,41	1.719	0,51
ACCIONES FERRARI	EUR	2.560	0,66	2.456	0,73
ACCIONES INGGROEP	EUR	7.501	1,95	5.640	1,67
ACCIONES PROSUS NV	EUR	5.842	1,52	6.483	1,92
ACCIONES BMW	EUR	2.875	0,75	2.749	0,81
ACCIONES BEIERSDORF	EUR	1.129	0,29	0	0,00
ACCIONES POST	EUR	3.729	0,97	4.201	1,24
ACCIONES DEUSCHETELECOM	EUR	11.423	2,96	10.028	2,96
ACCIONES DEUSCHE BOERSE	EUR	5.420	1,41	3.599	1,06
ACCIONES INFINEON TECH	EUR	3.995	1,04	3.608	1,07
<b>TOTAL RV COTITZADA</b>		<b>344.535</b>	<b>89,38</b>	<b>300.785</b>	<b>88,89</b>
<b>TOTAL RENDA VARIABLE EXT</b>		<b>344.535</b>	<b>89,38</b>	<b>300.785</b>	<b>88,89</b>
<b>TOTAL INVERSIONS FINANCERES EXTERIOR</b>		<b>344.535</b>	<b>89,38</b>	<b>300.785</b>	<b>88,89</b>
<b>TOTAL INVERSIONS FINANCERES</b>		<b>366.313</b>	<b>95,03</b>	<b>323.765</b>	<b>95,68</b>

Notes: el període es refereix a la fi del trimestre o semestre, segons el cas.

#### 3.2. DISTRIBUCIÓ DE LES INVERSIONS FINANCERES, AL TANCAMENT DEL PERÍODE (% RESPECTE AL PATRIMONI TOTAL)

#### TIPO DE ACTIVO



### 3.3. OPERACIONS EN DERIVATS

#### RESUM DE LES POSICIONS OBERTES AL TANCAMENT DEL PERÍODE (IMPORTS EN MILERS D'EUROS)

Instrument	Import nominal compromès	Objectiu de la inversió
<b>Total Operativa Derivats Drets</b>	<b>0</b>	
EUROSTOXX 50	20.215	Cobertura
<b>Total Operativa en Derivats Obligacions Renda Variable</b>	<b>20.215</b>	
<b>Total Operativa en Derivats Obligacions</b>	<b>20.215</b>	

### 4. FETS RELLEVANTS

	Sí	No
a.Suspensió temporal de subscripcions/reemborsaments		X
b.Represa de subscripcions/reemborsaments		X
c.Reemborsament de patrimoni significatiu		X
d.Endeutament superior al 5% del patrimoni		X
e.Substitució de la societat gestora		X
f.Substitució de l'entitat dipositària		X
g.Canvi de control de la societat gestora		X
h.Canvi en elements essencials del fulllet informatiu		X
i.Autorització del procés de fusió	X	
j.Altres fets rellevants	X	

### 5. ANNEX EXPLICATIU DE FETS RELLEVANTS

I) Es va autoritzar, a sol·licitud de CaixaBank Asset Management SGIIC, SA, com a entitat gestora, i de Cecabank, SA, com a entitat dipositària, la fusió per absorció de CaixaBank Bankia Index Eurozona, FI (inscrit en el registre corresponent de la CNMV amb el número 1137), per CaixaBank Bolsa Índice Euro, FI (inscrit en el registre corresponent de la CNMV amb el número 32).

Es va autoritzar, a sol·licitud de CaixaBank Asset Management SGIIC, SA, com a entitat gestora, i de Cecabank, SA, com a entitat dipositària, la fusió per absorció de CaixaBank Bankia Index Clima Mundial, FI (inscrit en el registre corresponent de la CNMV amb el número 5475), per CaixaBank Bolsa Índice Euro, FI (inscrit en el registre corresponent de la CNMV amb el número 32).

J) D'acord amb el que disposa la normativa vigent, CaixaBank Asset Management SGIIC, SAU, comunica que avui s'ha atorgat el contracte de fusió del fons CaixaBank Bankia Index Eurozona, FI, pel fons CaixaBank Bolsa Índice Euro, FI, i, per tant, la fusió té efecte jurídic ple.

Les equacions de bescanvi resultants han estat de:

- 2.420165931 participacions de CaixaBank Bolsa Índice Euro, FI, Clase Estándar per cada participació de CaixaBank Bankia Index Eurozona, FI, Clase Universal.
- 11.417119024 participacions de CaixaBank Bolsa Índice Euro, FI, Clase Extra per cada participació de CaixaBank Bankia Index Eurozona, FI, Clase Universal.
- 2.127364232 participacions de CaixaBank Bolsa Índice Euro, FI, Clase Institucional Plus per cada participació de CaixaBank Bankia Index Eurozona, FI, Clase Universal.
- 13.978876219 participacions de CaixaBank Bolsa Índice Euro, FI, Clase Cartera per cada participació de CaixaBank Bankia Index Eurozona, FI, Clase Cartera.

-11.031813573 participacions de CaixaBank Bolsa Índice Euro, FI, Clase Cartera per cada participació de CaixaBank Bankia Index Eurozona, FI, Clase Interna.

Considerant aquestes modificacions com un fet específicament rellevant i en compliment de les obligacions complementàries d'informació, li ho notifiquem perquè en faci difusió.

### 6. OPERACIONS VINCULADES I ALTRES INFORMACIONS

	Sí	No
a.Participis significatius en el patrimoni del fons (percentatge superior al 20%)	X	
b.Modificacions d'escassa rellevància en el reglament		X
c.La gestora i el dipositari són del mateix grup (segons l'article 4 de la CNMV)		X
d.S'han fet operacions d'adquisició i venda de valors en els quals el dipositari ha actuat com a venedor o comprador, respectivament	X	
e.S'han adquirit valors o instruments financers emesos o avalats per alguna entitat del grup de la gestora o del dipositari, o algun d'aquests ha actuat com a col·locador, assegurador, director o assessor, o s'han prestat valors a entitats vinculades		X
f.S'han adquirit valors o instruments financers la contrapartida dels quals ha estat una entitat del grup de la gestora o dipositari, o una altra IIC gestionada per la mateixa gestora o una altra gestora del grup		X
g.S'han percebut ingressos per entitats del grup de la gestora que tenen com a origen comissions o despeses satisfetes per la IIC		X
h.Altres informacions o operacions vinculades	X	

### 7. ANNEX EXPLICATIU SOBRE OPERACIONS VINCULADES I ALTRES INFORMACIONS

a) A la fi del període hi ha 1 participi amb 255.506.220,59 euros, que representen el 66,28 % del patrimoni, respectivament.

d.1) L'import total de les adquisicions en el període és 8.494.700,13 euros. La mitjana de les operacions d'adquisició del període respecte del patrimoni mitjà representa 0,01 %.

d.2) L'import total de les vendes en el període és 6.463.550,76 euros. La mitjana de les operacions de venda del període respecte del patrimoni mitjà representa 0,01 %.

h) S'han dut a terme operacions d'adquisició temporal d'actius amb pacte de recompra amb el dipositari, compra/venda d'IIC pròpies i d'altres per un import en valor absolut de 721,26 euros. En el període la mitjana d'aquest tipus d'operacions respecte del patrimoni mitjà és 0,00 %.

## 8. INFORMACIÓ I ADVERTIMENTS A INSTÀNCIA DE LA CNMV

## 9. ANNEX EXPLICATIU DE L'INFORME PERIÒDIC

### 1. SITUACIÓ DELS MERCATS I EVOLUCIÓ DEL FONS.

#### a) Visió de la gestora/societat sobre la situació dels mercats.

Tanquem un semestre i un any 2022 d'allò més complicats en termes de gestió d'actius i en què els canvis produïts en l'àmbit econòmic, geopolític o d'expectatives han marcat el pas d'uns mercats financers convulsos. Si hi ha dues paraules que han definit l'any i aquest segon semestre, són guerra i inflació.

El repunt inflacionista, que va començar en el seu mesurament general i després a poc a poc ha anat calant en el seu mesurament subjacent (sense el preu de l'energia i els aliments), ha estat d'una magnitud que no es veia des dels anys setanta després de la crisi del petroli. Això ha fet canviar el pas de manera dramàtica als bancs centrals perquè hi havia el risc cert que de començar a trobar-se per darrere dels esdeveniments. La Reserva Federal ha pujat els tipus als EUA 450 punts bàsics des de la banda de 0 %-0,25 % fins a la banda del 4,25 %-4,5 %, la pujada dels tipus d'interès més gran a Amèrica des de fa quatre dècades. L'enduriment monetari ha estat generalitzat. El 90 % dels bancs centrals ha pujat tipus al llarg de l'any. El Banc Central Europeu ha pujat els tipus a Europa 250 punts bàsics des de 0 % En el segon semestre.

En l'àmbit econòmic, tant la inflació com l'actuació dels bancs centrals s'han cobrat el seu peatge en forma d'alentiment econòmic. Així i tot, la tan anunciada recessió no ha acabat de produir-se i sembla que es retarda fins al 2023. En els darrers moviments de l'any s'ha començat a endevinar una retallada en el creixement dels preus.

L'evolució de la guerra a Ucraïna, amb els prometedors avenços del seu exèrcit, ha suscitat l'esperança d'una ràpida fi de la guerra. Malgrat això, l'any es tanca sense novetats gaire rellevants.

En aquest entorn els mercats han tingut un any de correccions generalitzades en totes les classes d'actius, en algunes de les quals, però, el moviment ha estat dramàtic, com ara la renda fixa. Si analitzem el comportament dels bons, el tresor americà ha corregit l'any -12,5 % i la renda fixa corporativa, -16 %. El 2022 l'alt rendiment americà ha corregit -11 %. En el cas europeu els bons governamentals han corregit entre -18 % i -22 %. El crèdit corporatiu europeu, -15 %. A més, la volatilitat associada a totes aquestes correccions en renda fixa no s'havia observat en anys.

Si tenim en compte l'abast d'aquestes correccions, el 2022 les caigudes en les borses han quedat minimitzades, tot i que, per exemple, l'S&P-500 ha corregit -19,44 %. En el cas europeu l'Eurostoxx-50 ha caigut -11,74 %, el Nikkei-225 japonès, -9,37 %, i l'Índex xinès de Xangai, -15,13 %. En matèries primeres l'any ha estat de pujades generalitzades a pràcticament totes. Destaquen les energètiques, com ara el petroli, amb pujades entre 25 % i 35 %, depenent del tipus de barril o el gas natural. En divises el triomfador ha estat el dòlar com a actiu refugi. La seva apreciació ha estat 5,85 % respecte de l'euro i de 13,94 % respecte del ien.

#### b) Decisions generals d'inversió que s'han adoptat.

Com que és un fons que reproduceix l'Índex DJ Eurostoxx-50 ESG Net TR, no pren decisions d'inversió. L'estratègia del fons continuarà centrada a replicar el comportament de l'Índex DJ Eurostoxx-50 ESG Net TR, mitjançant tant accions com futurs.

#### c) Índex de referència.

DJ Eurostoxx-50 ESG Net TR. L'error de seguiment del fons ha estat 0,205 %.

#### d) Evolució del patrimoni, participacions, rendibilitat i despeses de la IIC.

Durant el període el patrimoni del fons ha variat segons les classes 25,11 % (Estàndar), 10,97 % (Institucional Plus), -34,48 % (Cartera) i 60,67 % (Extra), i el nombre de participacions, 9,84 % (Estàndar), 0 % (Institucional Plus), 557 % (Cartera) i 37,5 % (Extra). Les despeses del fons han estat 0,53 %, 0,07 %, 0,07 % i 0,40 % en les classes Estàndar, Institucional Plus, Cartera i Extra. La rendibilitat del fons ha estat 9,18 %, 9,7 %, 9,70 % i 9,32 % en les classes Estàndar, Institucional Plus, Cartera i Extra, en la mateixa línia que la de l'Índex de referència, 9,68 %.

#### e) Rendiment del fons en comparació de la resta de fons de la gestora.

La rendibilitat del fons ha estat superior a la mitjana dels fons amb la mateixa vocació inversora, 4,22 %.

### 2. INFORMACIÓ SOBRE LES INVERSIONS.

#### a) Inversions concretes que s'han fet durant el període.

L'estratègia del fons ha consistit a intentar reproduir l'Índex DJ Eurostoxx ESG 50 Net TR fent servir tant inversions directes com futurs. Quant a les operacions normals del fons, s'han fet compres i vendes d'accions i futurs de l'Eurostoxx-50, el seu índex de referència, que, juntament amb l'evolució de la cartera, han donat un resultat positiu per al fons.

Els canvis en el període es fan per ajustar els valors del fons al seu índex de referència. En aquest període, amb data 19 de desembre s'han fet els ajustaments decidits pel comitè d'experts i es venen les posicions totals de BASF, Teleperformance, Carrefour, Michelin i Ryanair, per afegir-hi Beiersdorf, Volkswagen, Symrise, Sodexo i CNH.

En el període, els actius que han aportat més a la rendibilitat del fons han estat LVMH, TOTAL i ASML. D'altra banda, els detractors de rendibilitat han estat Adidas, Bayer i Vonovia.

#### b) Operacions de préstec de valors.

N/A

#### c) Operacions en derivats i adquisició temporal d'actius.

El fons ha dut a terme operacions amb instruments derivats per complementar les posicions de borsa per gestionar d'una manera més eficaç la cartera. El grau mitjà de palanquejament del període ha estat 1,73 %.

#### d) Més informació sobre inversions.

La remuneració de la liquiditat que ha mantingut la IIC ha estat 0,62 %.

### 3. EVOLUCIÓ DE L'OBJECTIU CONCRET DE RENDIBILITAT.

N/A

#### 4. RISC ASSUMIT PEL FONS.

La volatilitat, 23,12 %, 23,12 %, 23,12 % i 23,12 %, en les classes Estàndar, Institucional Plus, Extra i Cartera, ha estat superior a la del seu índex de referència, 22,79 %, i superior a la de la lletra del tresor.

#### 5. EXERCICI DE DRETS POLÍTICS.

CaixaBank AM, en el seu compromís per evolucionar cap a una economia sostenible en què es combini la rendibilitat a llarg termini amb la justícia social i la protecció al medi ambient, estableix en la seva política d'implicació els principis següents per a la participació en les decisions de les societats en què inverteix per mitjà d'accions de diàleg i mitjançant l'exercici dels drets polítics associats a la seva condició d'accionista.

La societat gestora exercirà el dret de vot i es basarà en l'avaluació del rendiment a mitjà i llarg termini de les companyies en què inverteix i d'acord amb la seva visió d'inversió socialment responsable. Es tindran en compte qüestions mediambientals (com ara la contaminació, l'ús sostenible dels recursos, el canvi climàtic i la protecció de la biodiversitat), socials (per exemple, la igualtat de gènere) i de governança (per exemple, les polítiques remuneratives), en la mateixa línia que la seva adhesió als principis per a la inversió responsable (PRI). Així, exercint el dret de vot, es pretén influir en les polítiques corporatives per a la millora de les deficiències detectades en matèria ASG.

CaixaBank AM disposa d'una entitat assessora especialitzada a elaborar recomanacions de vot sobre els assumptes que una determinada societat sotmetrà a votació en la seva junta d'accionistes per formar-se un judici des d'una perspectiva més àmplia i, així, exercitar els drets referits en la mateixa línia que el contingut en aquesta declaració.

La informació detallada de les activitats de vot així com les nostres polítiques de sostenibilitat es poden consultar a:

<https://www.caixabankassetmanagement.com/es/quienes-somos/inversion-sostenible/sostenibilidad-corporativa>

<https://vds.issgovernance.com/vds/#/MTEwMDY=>

### 6. INFORMACIÓ I ADVERTIMENTS CNMV.

N/A

#### 7. ENTITATS BENEFICIÀRIES DEL FONS SOLIDARI I IMPORT CEDIT A LES ENTITATS.

N/A

#### 8. COSTOS DERIVATS DEL SERVEI D'ANÀLISI.

N/A

#### 9. COMPARTIMENTS DE PROPÒSIT ESPECIAL (SIDE POCKETS).

N/A

#### 10. PERSPECTIVES DE MERCAT I ACTUACIÓ PREVISIBLE DEL FONS.

En aquest entorn, la nostra visió de mercats per al 2023 no ha sofert canvis; cal prudència respecte de les dades d'inflació, oimés arran dels darrers discursos i actes dels bancs centrals. Aquest cicle inflacionista no es pot donar per acabat. De fet, actualment pensem que la caiguda en la inflació es deu als components més volàtils però que no és extrapolable a la resta de la cistella de compra, especialment lloguers i serveis. En aquest sentit continuem pensant que el moment per a la inversió en renda variable encara ha d'arribar perquè en els primers moviments de l'any 2023 podem assistir a una revisió de beneficis empresarials que faci que les borses tornin a corregir. Mantenim un posicionament amb un enfocament més gran en sectors defensius i de qualitat. Els cíclics han rebotat excessivament per a l'escenari que se'ns planteja per al primer trimestre de 2023. En el cas de la renda fixa l'escenari és diametralment diferent. Al cap d'un any 2022 en què la correcció en el preu dels bons ha estat molt forta, no descartem que, després dels darrers discursos dels bancs centrals en el tancament de l'any, hagin plantejat una gran part de tota la "pólvora" restrictiva. Per això el moviment següent de compra pot ser la renda fixa governamental, per més endavant incorporar el grau d'inversió. Els tipus comencen a ser prou atractius si considerem que les expectatives d'inflació a llarg termini continuaran ancorades, els bancs centrals acabaran de fer bé el seu treball i els tipus d'interès terminals a banda i banda de l'Atlàntic s'aclariran definitivament. El moment continua sent d'extrema incertesa. Hem assistit a un any únic quant a expectatives i moviments de tipus d'interès i inflació. La possibilitat que finalment siguem davant un escenari de recessió tècnica es veurà les setmanes vinents, però no pas els mesos vinents. També caldrà estar a l'aguait d'aquest flux de dades i informació atès que els mercats descompen la conjuntura amb terminis des de sis mesos fins a un any. Per això no podem descartar un gir dels mercats financers més violent en el termini d'un o dos trimestres, segons la profunditat dels desequilibris i del control de la inflació dels bancs centrals.

Quant a l'actuació previsible del fons, continuarà centrada a replicar l'Índex Eurostoxx-50 ESG Net Return.

## 10. INFORMACIÓ SOBRE LA POLÍTICA DE REMUNERACIÓ

### 1) Dades quantitatives:

Remuneració total abonada per la SGIC al seu personal desglossada en:

Remuneració fixa: 15.789.445 €  
Remuneració variable: 3.280.726 €

Nombre de beneficiaris (s'especificarà el nombre total d'empleats i, dins d'aquests empleats, el nombre de beneficiaris de remuneració variable).

Nombre total d'empleats: 261  
Nombre de beneficiaris: 242

Remuneració lligada a la comissió de gestió variable de la IIC. S'indica que no n'hi ha per a les IIC que no apliquin aquest tipus de remuneració.

No existeix aquest tipus de remuneració

Remuneració desglossada en:

Alts càrrecs: s'indica el nombre de persones incloses en aquesta categoria i es desglossa en remuneració fixa i variable.

Nombre de persones: 9  
Remuneració fixa: 1.467.000 €  
Remuneració variable: 498.900 €

Empleats l'actuació dels quals tingui una incidència material en el perfil de risc de la IIC (entenen que totes les SGIC disposen d'empleats dins d'aquest grup): s'indica el nombre de persones incloses en aquesta categoria i es desglossa en remuneració fixa i variable:

Nombre de persones: 10  
Remuneració fixa: 1.304.889 €  
Remuneració variable: 548.471 €

### 2) Contingut qualitatiu:

La política de remuneració de CaixaBank Asset Management SGIC, SAU (a partir d'ara CaixaBank AM), constitueix un aspecte fonamental del seu govern corporatiu, a causa de la influència potencial que les pràctiques de remuneració poden exercir en el perfil de risc de la SGIC i de les IIC que gestiona, així com en els conflictes d'interès potencials, tot això d'acord amb la normativa sectorial aplicable.

CaixaBank AM, com a SGIC i prestadora de serveis d'inversió, requereix dotar-se d'unes polítiques adequades de remuneració, tant en relació amb els alts directius, els prenedors de risc i les persones que exerceixen funcions de control com en general amb la resta del personal de l'entitat.

D'acord amb això, CaixaBank AM disposa d'una política de remuneració per als seus empleats segons una gestió racional i eficaç del risc, i la normativa aplicable a les IIC gestionades. Aquesta política segueix els principis de l'estratègia empresarial, dels objectius, dels valors i dels interessos a llarg termini propis i de les institucions d'inversió col·lectiva que gestiona, dels seus partícips o accionistes, i de l'interès públic, i inclou mesures per evitar els conflictes d'interès. La política de compensació total està orientada a impulsar comportaments que assegurin la creació de valor a llarg termini i la sostenibilitat dels resultats en el temps.

En general, la proporció de la remuneració variable pel que fa a la remuneració fixa anual és relativament reduïda. La proporció del component fix de la remuneració permet aplicar una política flexible de remuneració variable, que inclou la possibilitat, en els casos que preveu la política, de no abonar cap quantitat de remuneració variable en un exercici determinat.

En cas que els professionals que fan funcions de control tinguin remuneració variable, els seus objectius no han d'incloure reptes de negoci des del punt individual, de l'àrea o de les IIC gestionades, a fi d'assegurar la seva independència respecte de les àrees que supervisen.

Es prohibeix als professionals de CaixaBank AM fer servir estratègies personals de cobertura i assegurement de les seves remuneracions o de les obligacions que hi estan relacionades, amb la finalitat de deteriorar l'alineació amb el perfil de risc implícit en aquesta estructura de remuneració.

La remuneració variable per als professionals de CaixaBank AM està orientada a esperar comportaments que assegurin la generació de valor a llarg termini i la sostenibilitat dels resultats en el temps, i es basa en la combinació de remuneració (proporcionalitat entre remuneració fixa i variable, descrita més amunt) i en el mesurament de l'execució. En cap cas la remuneració variable no està vinculada solament i directament a decisions individuals de gestió o criteris que incentivin l'assumpció de riscos incompatible amb el perfil de risc de l'entitat o les seves normes en matèria de conducta o conflictes d'interessos, les IIC que gestiona i els seus partícips.

La determinació de la remuneració variable es basa en una combinació del mesurament de l'acompliment individual, de l'àrea, unitat de negoci o IIC concernides (en la mesura en què sigui aplicable), tenint en compte criteris quantitius (financers) i qualitius (no financers) fixats en l'àmbit de l'entitat, d'àrea o individualment segons el que sigui procedent.

Així mateix, el pagament de la remuneració variable no es duu a terme per mitjà de vehicles o mètodes que puguin facilitar l'elusió de les normes contingudes en la política.

El grup d'empleats que pertanyen a l'Àrea d'Inversions disposa d'un pla de remuneració variable o programa de bonus específic, que incorpora una combinació de reptes o indicadors relacionats, d'una banda, amb els resultats de l'empresa i, de l'altra, amb els resultats de les IIC gestionades, tant des del punt de vista individual com de departament i l'àrea.

Per als empleats de la resta d'àrees, a més dels indicadors relacionats amb els resultats de l'empresa, el seu programa de remuneració variable incorpora un seguit de reptes que es fixen mitjançant un acord de cada professional amb el seu responsable funcional, i que han de ser coincidents amb els reptes de l'àrea a què pertany i amb els globals de la companyia.

Als membres del col·lectiu identificat, l'activitat dels quals pot tenir una incidència significativa sobre el perfil de risc de la gestora o de les IIC que gestionen, s'hi aplicarà addicionalment la política de compensació específica que preveu que la remuneració variable es farà per mitjà d'instruments financers i que estarà sotmesa a ajornament.

Durant l'exercici 2022 hi ha hagut modificacions en la política de remuneracions de l'entitat per incorporar el nou model de retribució variable del col·lectiu identificat.

La revisió feta durant aquest exercici ha posat de manifest que tant la seva aplicació com la determinació del col·lectiu identificat i el disseny de la política compleixen els requeriments reguladors vigents.

## 11. INFORMACIÓ SOBRE LES OPERACIONS DE FINANÇAMENT DE VALORS, REUTILITZACIÓ DE LES GARANTIES I SWAPS DE RENDIMENT TOTAL (REGLAMENT UE 2015/2365)