

# CAIXABANK BANKIA INDEX EUROZONA, FI

Informe Primer semestre 2022

Nº Registro CNMV: 1137

Fecha de registro: 13/08/1997

Gestora: CaixaBank Asset Management SGIC, S.A.

Depositario: CECABANK SA

Grupo Gestora/Depositario: / CECA

Rating Depositario: BBB+

Auditor: DELOITTE

El presente informe, junto con los últimos informes periódicos, se encuentran disponibles por medios telemáticos en [www.caixabank.es](http://www.caixabank.es) o [www.caixabankassetmanagement.com](http://www.caixabankassetmanagement.com)

La Entidad Gestora atenderá las consultas de los clientes, relacionadas con las IIC gestionadas en Pº de la Castellana 51, 5º pl. 28046 Madrid tel. /, correo electrónico a través de formulario disponible en [www.caixabank.es](http://www.caixabank.es)

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

## 1. POLÍTICA DE INVERSIÓN Y DIVISA DE DENOMINACIÓN

**CATEGORÍA:** Tipo de fondo: Fondo que replica o reproduce un índice; Vocación inversora: IIC que replica un índice; Perfil riesgo: 6 en una escala del 1 al 7

**DESCRIPCIÓN GENERAL:** Fondo de renta variable que replica o reproduce el índice bursátil Dow Jones Euro Stoxx 50.

**OPERATIVA EN INSTRUMENTOS DERIVADOS:** El fondo ha realizado operaciones con instrumentos derivados con la finalidad de inversión para gestionar de un modo más eficaz la cartera. La metodología aplicada para calcular la exposición total al riesgo es la metodología del compromiso. Una información más detallada sobre la política de inversión del fondo se puede encontrar en su folleto informativo. La metodología aplicada para calcular la exposición total al riesgo de mercado es el método del compromiso. Una información más detallada sobre la política de inversión del fondo se puede encontrar en su folleto informativo.

**DIVISA DE DENOMINACIÓN:** EUR

## 2. DATOS ECONÓMICOS

### 2.1. DATOS GENERALES

	Periodo Actual	Periodo Anterior	Año actual	Año anterior
Índice de rotación de la cartera	0,00	0,00	0,00	0,00
Rentabilidad media de la liquidez (% anualizado)	-0,12	-0,23	-0,12	-0,19

Nota: El período se refiere al trimestre o semestre, según sea el caso. En el caso de IIC cuyo valor liquidativo no se determine diariamente, los datos se refieren al último disponible.

#### CAIXABANK BANKIA INDEX EUROZONA, FI CLASE CARTERA

	Periodo actual	Periodo anterior	Fecha	Patrimonio (miles de euros)	Valor liquidativo (euros)	Comisiones aplicadas en el período, sobre patrimonio medio	% efectivamente cobrado		Base de cálculo
							Periodo	Acumulada	
Nº de participaciones	2.080,55	4.395,52	Período	223	107,4087	Comisión de gestión	0,18	0,18	Patrimonio
Nº de partícipes	7	11	2021	574	130,6883	Comisión de resultados	0,00	0,00	Resultados
Benef. brutos distrib. por particip. (Euros)	0,00	0,00	2020	1.403	105,8889	Comisión de gestión total	0,18	0,18	Mixta
			2019	2.536	109,1440	Comisión de despositario	0,05	0,05	Patrimonio

Inversión mínima:

#### CAIXABANK BANKIA INDEX EUROZONA, FI CLASE UNIVERSAL

	Periodo actual	Periodo anterior	Fecha	Patrimonio (miles de euros)	Valor liquidativo (euros)	Comisiones aplicadas en el período, sobre patrimonio medio	% efectivamente cobrado		Base de cálculo
							Periodo	Acumulada	
Nº de participaciones	289.662,41	328.603,02	Período	24.581	84,8608	Comisión de gestión	0,45	0,45	Patrimonio
Nº de partícipes	1.270	1.429	2021	34.020	103,5300	Comisión de resultados	0,00	0,00	Resultados
Benef. brutos distrib. por particip. (Euros)	0,00	0,00	2020	29.491	84,3420	Comisión de gestión total	0,45	0,45	Mixta
			2019	28.586	87,4383	Comisión de despositario	0,05	0,05	Patrimonio

Inversión mínima: 100 EUR

#### CAIXABANK BANKIA INDEX EUROZONA, FI CLASE INTERNA

	Periodo actual	Periodo anterior	Fecha	Patrimonio (miles de euros)	Valor liquidativo (euros)	Comisiones aplicadas en el período, sobre patrimonio medio	% efectivamente cobrado		Base de cálculo
							Periodo	Acumulada	
Nº de participaciones	10,00	10,00	Período	1	84,6430	Comisión de gestión	0,00	0,00	Patrimonio
Nº de partícipes	1	1	2021	1	102,7490	Comisión de resultados	0,00	0,00	Resultados
Benef. brutos distrib. por particip. (Euros)	0,00	0,00	2020	0	100,0000	Comisión de gestión total	0,00	0,00	Mixta
			2019	0	100,0000	Comisión de despositario	0,00	0,00	Patrimonio

Inversión mínima:

### 2.2. COMPORTAMIENTO

#### 2.2.1. Individual - CAIXABANK BANKIA INDEX EUROZONA, FI. Divisa EUR

##### Rentabilidad (% sin anualizar)

#### CAIXABANK BANKIA INDEX EUROZONA, FI CLASE CARTERA

	Acumulado año actual	Trimestral				Anual			
		30-06-22	31-03-22	31-12-21	30-09-21	2021	2020	2019	2017
Rentabilidad	-17,81	-9,68	-9,00	6,34	-0,02	23,42			
Desviación resp.al índice	0,31	0,31	0,68	0,77	0,00	0,77			

	Trimestre actual		Último año		Últimos 3 años	
	%	Fecha	%	Fecha	%	Fecha
Rentabilidad extremas*						
Rentabilidad mínima (%)	-3,37	10-06-22	-4,96	04-03-22	--	--
Rentabilidad máxima (%)	2,82	24-06-22	7,37	09-03-22	--	--

**CAIXABANK BANKIA INDEX EUROZONA, FI CLASE UNIVERSAL**

	Acumulado año actual	Trimestral				Anual			
		30-06-22	31-03-22	31-12-21	30-09-21	2021	2020	2019	2017
Rentabilidad	-18,03	-9,81	-9,12	6,19	-0,16	22,75			
Desviación resp.al índice	0,31	0,31	0,68	0,77	0,00	0,77			
		Trimestre actual		Último año		Últimos 3 años			
		%	Fecha	%	Fecha	%	Fecha		
Rentabilidad mínima (%)		-3,37	10-06-22	-4,96	04-03-22		--		
Rentabilidad máxima (%)		2,82	24-06-22	7,36	09-03-22		--		

**CAIXABANK BANKIA INDEX EUROZONA, FI CLASE INTERNA**

	Acumulado año actual	Trimestral				Anual			
		30-06-22	31-03-22	31-12-21	30-09-21	2021	2020	2019	2017
Rentabilidad	-17,62	-9,58	-8,90	2,75	0,00	2,75			
Desviación resp.al índice	0,31	0,31	0,68	0,77	0,00	0,77			
		Trimestre actual		Último año		Últimos 3 años			
		%	Fecha	%	Fecha	%	Fecha		
Rentabilidad mínima (%)		-3,37	10-06-22	-4,96	04-03-22		--		
Rentabilidad máxima (%)		2,82	24-06-22	7,37	09-03-22		--		

\* Sólo se informa para las clases con una antigüedad mínima del periodo solicitado y siempre que no se haya modificado su vocación inversora. Se refiere a las rentabilidades máximas y mínimas entre dos valores liquidativos consecutivos. La periodicidad de cálculo del valor liquidativo es diaria.

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

**Medidas de riesgo (%)**

Volatilidad * de:	Acumulado año actual	Trimestral				Anual			
		30-06-22	31-03-22	31-12-21	30-09-21	2021	2020	2019	2017
Ibex-35 Net TR	22,51	19,91	24,93	18,34	16,09	16,23			
Letra Tesoro 1 año	0,03	0,03	0,02	0,02	0,02	0,02			
100% Eurostoxx 50 (SX5T)	27,14	22,94	31,03	16,97	14,69	14,02			

**CAIXABANK BANKIA INDEX EUROZONA, FI CLASE CARTERA**

Volatilidad * de:	Acumulado año actual	Trimestral				Anual			
		30-06-22	31-03-22	31-12-21	30-09-21	2021	2020	2019	2017
Valor Liquidativo	27,29	22,94	31,22	18,14	14,91	14,99			
VaR histórico **	8,83	8,83	7,30	7,06	7,00	7,06			

**CAIXABANK BANKIA INDEX EUROZONA, FI CLASE UNIVERSAL**

Volatilidad * de:	Acumulado año actual	Trimestral				Anual			
		30-06-22	31-03-22	31-12-21	30-09-21	2021	2020	2019	2017
Valor Liquidativo	27,29	22,94	31,22	18,14	14,91	14,99			
VaR histórico **	8,87	8,87	7,35	7,11	7,04	7,11			

**CAIXABANK BANKIA INDEX EUROZONA, FI CLASE INTERNA**

Volatilidad * de:	Acumulado año actual	Trimestral				Anual			
		30-06-22	31-03-22	31-12-21	30-09-21	2021	2020	2019	2017
Valor Liquidativo	27,29	22,94	31,22	6,70	0,00	0,00			
VaR histórico **	8,44	8,44	5,48	0,00	0,00	0,00			

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

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

**Gastos (% s/ patrimonio medio)**
**CAIXABANK BANKIA INDEX EUROZONA, FI**

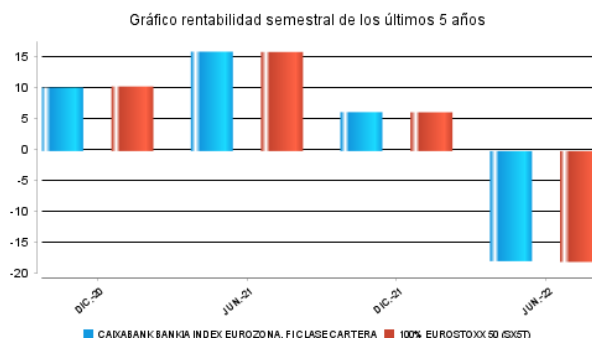
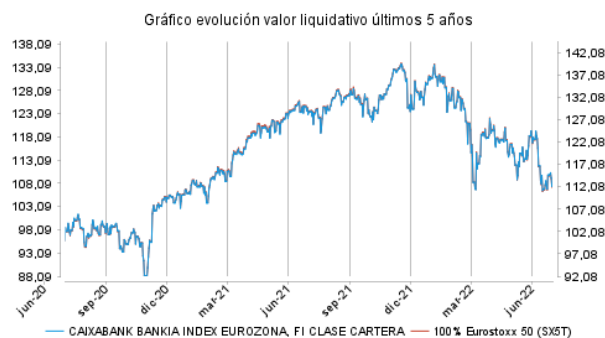
Ratio total de gastos *	Acumulado año actual	Trimestral				Anual			
		30-06-22	31-03-22	31-12-21	30-09-21	2021	2020	2019	2017
CLASE CARTERA	0,24	0,12	0,12	0,12	0,12	0,47	0,48	0,48	
CLASE UNIVERSAL	0,51	0,25	0,25	0,26	0,26	1,01	1,01	1,01	1,01
CLASE INTERNA	0,01	0,00	0,00	0,00	0,02	0,01	0,01		

\* 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.

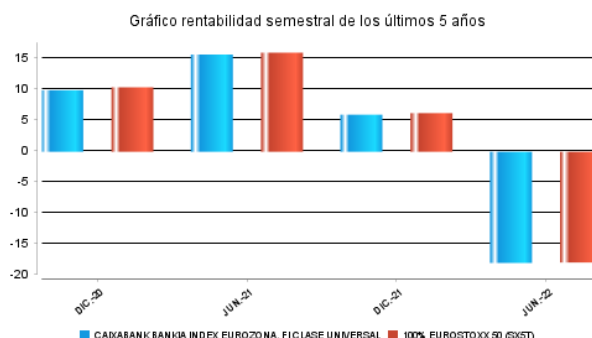
Evolución del valor liquidativo últimos 5 años

Rentabilidad semestral de los últimos 5 años

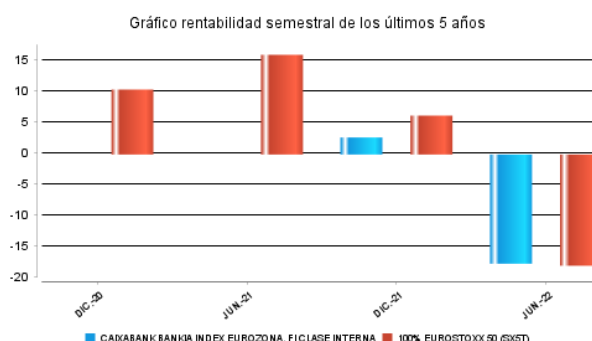
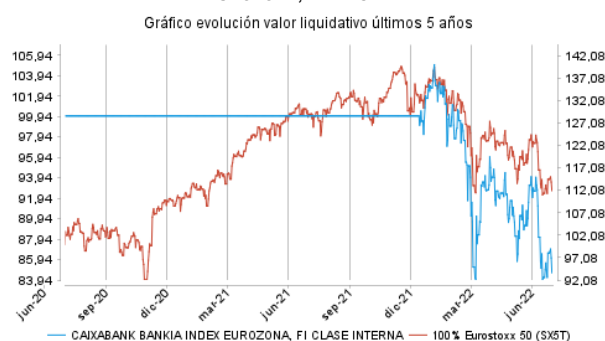
### CAIXABANK BANKIA INDEX EUROZONA, FI CLASE CARTERA



### CAIXABANK BANKIA INDEX EUROZONA, FI CLASE UNIVERSAL



### CAIXABANK BANKIA INDEX EUROZONA, FI CLASE INTERNA



## 2.2.2. Comparativa

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

Vocación inversora	Patrimonio gestionado* (miles de euros)	Nº de participes*	Rentabilidad semestral media**
Renta Fija euro	15.060.992	1.717.552	-6,33
Renta Fija Internacional	2.888.365	679.341	-5,49
Renta Fija Mixta Euro	2.677.805	91.441	-8,67
Renta Fija Mixta Internacional	7.475.454	215.990	-8,97
Renta Variable Mixta Euro	132.699	7.419	-15,08
Renta Variable Mixta Internacional	3.300.676	116.691	-12,42
Renta Variable Euro	604.716	283.786	-6,65
Renta Variable Internacional	15.120.101	2.243.117	-12,95
IIC de gestión Pasiva (I)	0	0	0,00
Garantizado de Rendimiento Fijo	366.729	13.887	-4,05
Garantizado de Rendimiento Variable	873.624	37.202	-1,95
De Garantía Parcial	0	0	0,00
Retorno Absoluto	3.282.717	441.656	-4,09
Global	7.960.330	261.981	-14,65
FMM a corto plazo de valor liquidativo variable	0	0	0,00
FMM a corto plazo de valor liquidativo constante de deuda publica	0	0	0,00
FMM a corto plazo de valor liquidativo de baja volatilidad	0	0	0,00
FMM estándar de valor liquidativo variable	3.973.391	83.012	-0,52
Renta fija euro corto plazo	7.549.326	534.765	-0,55
IIC que replica un índice	927.845	19.775	-12,03
IIC con objetivo concreto de rentabilidad no garantizado	1.228.227	46.005	-3,19
<b>Total Fondo</b>	<b>73.422.999</b>	<b>6.793.620</b>	<b>-8,16</b>

\*Medias.

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

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

### 2.3. DISTRIBUCIÓN DEL PATRIMONIO AL CIERRE DEL PERIODO (IMPORTES EN MILES DE EUROS)

Distribución del patrimonio	Fin periodo actual		Fin periodo anterior	
	Importe	% sobre patrimonio	Importe	% sobre patrimonio
(+) INVERSIONES FINANCIERAS	23.473	94,63	33.896.405	97,98
* Cartera interior	1.409	5,68	1.863.755	5,39
* Cartera exterior	22.064	88,95	32.032.650	92,59
* Intereses cartera inversión	0	0,00	0	0,00
* Inversiones dudosas, morosas o en litigio	0	0,00	0	0,00
(+) LIQUIDEZ (TESORERÍA)	250	1,01	359.914	1,04
(+/-) RESTO	1.082	4,36	339.433	0,98
<b>TOTAL PATRIMONIO</b>	<b>24.805</b>	<b>100,00</b>	<b>34.595.752</b>	<b>100,00</b>

Notas:  
El período se refiere al trimestre o semestre, según sea el caso.  
Las inversiones financieras se informan a valor estimado de realización.

### 2.4. ESTADO DE VARIACIÓN PATRIMONIAL

	% sobre patrimonio medio			
	Variación del periodo actual	Variación del periodo anterior	Variación acumulada anual	% Variación respecto fin periodo anterior
<b>PATRIMONIO FIN PERIODO ANTERIOR (miles de euros)</b>	34.595.752	35.552.095	34.595.752	
± Suscripciones/ reembolsos (neto)	-13,07	-8,58	-13,07	24,44
Beneficios brutos distribuidos	0,00	0,00	0,00	0,00
± Rendimientos netos	-20,05	5,85	-20,05	-187,07
(+) Rendimientos de gestión	-19,37	6,41	-19,37	0,00
+ Intereses	0,00	-0,02	0,00	-92,58
+ Dividendos	2,46	0,56	2,46	-1,50
± Resultados en renta fija (realizadas o no)	0,00	0,01	0,00	-101,32
± Resultados en renta variable (realizadas o no)	-20,99	5,52	-20,99	-204,27
± Resultado en depósitos (realizadas o no)	0,00	0,00	0,00	0,00
± Resultado en derivados (realizadas o no)	-0,84	0,34	-0,84	-145,59
± Resultado en IIC (realizados o no)	0,00	0,00	0,00	0,00
± Otros Resultados	0,00	0,00	0,00	-100,00
± Otros rendimientos	0,00	0,00	0,00	0,00
(-) Gastos repercutidos	-0,68	-0,55	-0,68	-51,20
- Comisión de gestión	-0,44	-0,44	-0,44	-56,17
- Comisión de depositario	-0,05	-0,05	-0,05	-57,04
- Gastos por servicios exteriores	-0,01	-0,01	-0,01	-12,36
- Otros gastos de gestión corriente	0,00	0,00	0,00	-91,49
- Otros gastos repercutidos	-0,18	-0,05	-0,18	-26,45
(+) Ingresos	0,00	-0,01	0,00	0,00
+ Comisiones de descuento a favor de la IIC	0,00	0,00	0,00	0,00
+ Comisiones retrocedidas	0,00	0,00	0,00	0,00
+ Otros ingresos	0,00	-0,01	0,00	0,00
<b>PATRIMONIO FIN PERIODO ACTUAL (miles de euros)</b>	<b>24.805.287</b>	<b>34.595.752</b>	<b>24.805.287</b>	

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

## 3. INVERSIONES FINANCIERAS

### 3.1. INVERSIONES FINANCIERAS A VALOR ESTIMADO DE REALIZACIÓN (EN MILES DE EUROS) AL CIERRE DEL PERÍODO

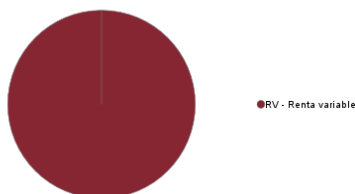
Descripción de la inversión y emisor	Divisa	Periodo actual		Periodo anterior	
		Valor de mercado	%	Valor de mercado	%
ACCIONES BBVA	EUR	244	0,98	366	1,06
ACCIONES BSAN	EUR	418	1,68	533	1,54
ACCIONES IBERDROLA	EUR	529	2,13	633	1,83
ACCIONES INDITEX	EUR	218	0,88	332	0,96
<b>TOTAL RENTA VARIABLE COTIZADA</b>		<b>1.409</b>	<b>5,67</b>	<b>1.864</b>	<b>5,39</b>
<b>TOTAL RENTA VARIABLE</b>		<b>1.409</b>	<b>5,67</b>	<b>1.864</b>	<b>5,39</b>
<b>TOTAL INTERIOR</b>		<b>1.409</b>	<b>5,67</b>	<b>1.864</b>	<b>5,39</b>
ACCIONES ANHEUSER-BUSCH	EUR	417	1,68	495	1,43
ACCIONES BMW	EUR	214	0,86	297	0,86
ACCIONES POST	EUR	320	1,29	583	1,68
ACCIONES DEUTSCHE TELECOM	EUR	598	2,41	591	1,71
ACCIONES DEUTSCHE BOERSE	EUR	276	1,11	292	0,84
ACCIONES INFINEON TECH	EUR	274	1,11	557	1,61
ACCIONES DAIMLER AG	EUR	395	1,59	593	1,72
ACCIONES SAP	EUR	862	3,48	1.427	4,12
ACCIONES SIEMENS	EUR	663	2,67	1.200	3,47
ACCIONES VOLKSWAGEN	EUR	212	0,86	340	0,98
ACCIONES ALLIANZ	EUR	677	2,73	887	2,56
ACCIONES MUNICHENER R.	EUR	286	1,15	382	1,10
ACCIONES ADIDAS-SALOMON	EUR	274	1,10	495	1,43
ACCIONES VONOVIA SE	EUR	192	0,77	354	1,02
ACCIONES BASF	EUR	347	1,40	593	1,72
ACCIONES BAYER	EUR	507	2,04	483	1,40
ACCIONES KONE OYJ	EUR	166	0,67	266	0,77
ACCIONES HERMES INTERNAT	EUR	343	1,38	565	1,63
ACCIONES SAFRAN	EUR	325	1,31	427	1,23
ACCIONES AIRLIQUIDE	EUR	609	2,46	760	2,20
ACCIONES TOTAL FINA	EUR	1.196	4,82	1.232	3,56

ACCIONES LOREAL	EUR	728	2,93	1.056	3,05
ACCIONES SANOFI	EUR	1.005	4,05	1.061	3,07
ACCIONES AXA	EUR	389	1,57	564	1,63
ACCIONES DANONE	EUR	310	1,25	372	1,07
ACCIONES PERNOD	EUR	327	1,32	454	1,31
ACCIONES LVMH MOET HENNE	EUR	1.393	5,61	2.004	5,79
ACCIONES KERING	EUR	324	1,31	540	1,56
ACCIONES ESSILORLUXOTTIC	EUR	391	1,57	590	1,71
ACCIONES SCHNEIDER	EUR	585	2,36	1.026	2,97
ACCIONES VINCI	EUR	434	1,75	581	1,68
ACCIONES BNP	EUR	469	1,89	733	2,12
ACCIONES CRH	EUR	232	0,94	387	1,12
ACCIONES FLUTTER	EUR	154	0,62	255	0,74
ACCIONES LINDE PLC	EUR	1.246	5,02	1.635	4,73
ACCIONES INTESA SANPAOLO	EUR	295	1,19	434	1,25
ACCIONES ENEL	EUR	369	1,49	572	1,65
ACCIONES ENI	EUR	259	1,04	321	0,93
ACCIONES PHILLIPS	EUR	165	0,67	314	0,91
ACCIONES EADS	EUR	491	1,98	684	1,98
ACCIONES ASML HOLDING NV	EUR	1.685	6,79	3.055	8,83
ACCIONES AHOLD	EUR	236	0,95	330	0,95
ACCIONES INGGROEP	EUR	335	1,35	500	1,44
ACCIONES ADYEN NV	EUR	361	1,45	682	1,97
ACCIONES PROSUS NV	EUR	508	2,05	670	1,94
ACCIONES STELLANTIS	EUR	243	0,98	395	1,14
<b>TOTAL RENTA VARIABLE COTIZADA</b>		<b>22.087</b>	<b>89,02</b>	<b>32.033</b>	<b>92,58</b>
<b>TOTAL RENTA VARIABLE</b>		<b>22.087</b>	<b>89,02</b>	<b>32.033</b>	<b>92,58</b>
<b>TOTAL EXTERIOR</b>		<b>22.087</b>	<b>89,02</b>	<b>32.033</b>	<b>92,58</b>
<b>TOTAL INVERSION FINANCIERA</b>		<b>23.496</b>	<b>94,69</b>	<b>33.896</b>	<b>97,97</b>

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

### 3.2. DISTRIBUCIÓN DE LAS INVERSIONES FINANCIERAS, AL CIERRE DEL PERÍODO (% SOBRE EL PATRIMONIO TOTAL)

TIPO DE ACTIVO



### 3.3. OPERATIVA EN DERIVADOS

RESUMEN DE LAS POSICIONES ABIERTAS AL CIERRE DEL PERÍODO (IMPORTES EN MILES DE EUROS)

Instrumento	Importe nominal comprometido	Objetivo de la inversión
<b>Total Operativa Derivados Derechos</b>	<b>0</b>	
EUROSTOXX 50	1.367	Cobertura
Total Operativa Derivados Obligaciones Renta Variable	1.367	
<b>Total Operativa Derivados Obligaciones</b>	<b>1.367</b>	

### 4. HECHOS RELEVANTES

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

### 5. ANEXO EXPLICATIVO DE HECHOS RELEVANTES

J) CaixaBank Asset Management SGIIC, SAU, Entidad Gestora de dichos Fondos, comunica que, con efectos desde el 29 de abril de 2022 inclusive, la comisión de reembolso de la Clase Universal del 2% aplicada a las participaciones con antigüedad inferior a 7 días dejará de aplicarse en los traspasos realizados a otros Fondos gestionados por CaixaBank Asset Management SGIIC, SAU.

CaixaBank Asset Management SGIIC, SAU, Entidad Gestora de dicho Fondo, comunica que, con efectos desde el 29 de junio de 2022 inclusive, se eliminará en la clase Universal la comisión de reembolso del 2% aplicada a las participaciones con antigüedad inferior a 7 días.

## 6. OPERACIONES VINCULADAS Y OTRAS INFORMACIONES

	Si	No
a.Participes 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 CNMV)		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 ha adquirido valores o instrumentos financieros emitidos o avalados por alguna entidad del grupo de la gestora o depositario, o alguno de estos ha actuado como colocador, asegurador, director o asesor, o se han prestado valores a entidades vinculadas		X
f.Se han adquirido valores o instrumentos financieros cuya contrapartida ha sido una entidad del grupo de la gestora o depositario, u otra IIC gestionada por la misma gestora u otra gestora del grupo		X
g.Se han percibido ingresos por entidades del grupo de la gestora que tienen como origen comisiones o gastos satisfechos por la IIC	X	
h.Otras informaciones u operaciones vinculadas	X	

## 7. ANEXO EXPLICATIVO SOBRE OPERACIONES VINCULADAS Y OTRAS INFORMACIONES

- g) Los ingresos percibidos por entidades del grupo de la gestora que tiene como origen comisiones o gastos satisfechos por la IIC en concepto de comisiones por intermediación, comisiones por rebates, comisiones por llevanza libro de accionistas y comisiones por administración, representan un 0,00 % sobre el patrimonio medio del periodo.
- h) Se han realizado operaciones de adquisición temporal de activos con pacto de recompra con el depositario, compra/venta de IIC propias y otras por un importe en valor absoluto de 434,22 EUR. La media de este tipo de operaciones en el periodo respecto al patrimonio medio representa un 0,00 %.

## 8. INFORMACIÓN Y ADVERTENCIAS A INSTANCIA DE LA CNMV

No aplicable

## 9. ANEXO EXPLICATIVO DEL INFORME PERIÓDICO

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

#### a) Visión de la gestora/sociedad sobre la situación de los mercados.

#### b) Decisiones generales de inversión adoptadas.

Al ser un fondo indexado al Euro Stoxx 50 Net Return Index no toma decisiones de inversión. El Covid no ha impactado en la gestión de este fondo, no habiéndose tomado decisiones por este motivo.

#### c) Índice de referencia.

Euro Stoxx 50 Net Return Index. El tracking error del fondo ha sido de 0,30%.

#### d) Evolución del Patrimonio, participes, rentabilidad y gastos de la IIC.

Durante el periodo el patrimonio del fondo ha variado según clase en un -27,75% (Universal), -61,10%(Cartera) y -17,62% (Interna), y el número de participes en un -11,13% (Universal), -36,36%(Cartera) y 0,00% (Interna). Los gastos soportados por el fondo han sido del 0,51%, 0,24% y 0,01% para las clases Universal, Cartera e Interna. La rentabilidad del fondo ha sido del -18,03%, -17,81% y -17,62% en la clase Universal, Cartera e Interna, similar a la del índice de referencia de -17,95%.

#### e) Rendimiento del fondo en comparación con el resto de fondos de la gestora.

La rentabilidad del fondo ha sido inferior a la media de los fondos con la misma vocación inversora, de -12,03%.

### 2. INFORMACION SOBRE LAS INVERSIONES.

#### a) Inversiones concretas realizadas durante el periodo.

La estrategia del fondo ha consistido en tratar de replicar el comportamiento del índice Euro Stoxx 50 Net Return Index, utilizando tanto valores del índice como derivados. Dentro de la operativa normal del fondo se han realizado compras y ventas de acciones y también de derivados sobre el índice, que junto con la evolución de la cartera han generado un resultado negativo para el fondo. En el periodo no se han tomado decisiones de inversión motivadas por el impacto del virus COVID 19.

#### b) Operativa de préstamo de valores.

N/A

#### c) Operativa en derivados y adquisición temporal de activos.

El fondo ha realizado operaciones con instrumentos derivados para conseguir el objetivo de inversión y gestionar de un modo más eficaz la cartera. El grado medio de apalancamiento del periodo ha sido del 2,02%.

#### d) Otra información sobre inversiones.

La remuneración de la liquidez mantenida por la IIC ha sido de -0,12%.

### 3. EVOLUCIÓN DEL OBJETIVO CONCRETO DE RENTABILIDAD.

N/A

### 4. RIESGO ASUMIDO POR EL FONDO.

La volatilidad de un 27,29%, 27,29% y 27,29% para las clases Universal, Cartera e Interna, ha sido superior a la de su índice de referencia 27,14% y superior a la de la letra del tesoro.

### 5. EJERCICIO DERECHOS POLÍTICOS.

N/A

### 6. INFORMACIÓN Y ADVERTENCIAS CNMV.

N/A

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

N/A

### 8. COSTES DERIVADOS DEL SERVICIO DE ANÁLISIS.

N/A

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

N/A

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

Nos encontramos en un momento de incertidumbre máxima de cara al otoño y el mercado estará atento a una potencial recesión técnica como consecuencia de los agresivos movimientos de tipos de intervención por parte de los bancos centrales. Esto invita a seguir cautos a la espera de contrastar la fortaleza de los consumidores, la estabilización de los repuntes inflacionistas, la evolución de los resultados empresariales y las consecuencias de eventos como la guerra de Ucrania.

## 10. INFORMACIÓN SOBRE LA 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)