

Anexo al Folleto del Fondo CaixaBank Bolsa Índice Euro

Nombre del producto: **CaixaBank Bolsa Índice Euro, FI**

Código LEI (*Legal entity identifier*): **95980020140005347690**

Nº Registro Fondo CNMV: **32**

Características medioambientales y/o sociales

¿Este producto financiero tiene un objetivo de inversión sostenible?

Si No

Realizará un mínimo de **inversiones sostenibles con un objetivo ambiental**: ___%

en actividades económicas que califican como ambientalmente sostenibles según la Taxonomía de la UE

en actividades económicas que no califican como ambientalmente sostenibles según la Taxonomía de la UE

Realizará un mínimo de **inversiones sostenibles con un objetivo social**: ___%

Promueve características Ambientales / Sociales (E / S), y si bien no tiene como objetivo una inversión sostenible, tendrá una proporción mínima del ___% de inversiones sostenibles.

con un objetivo medioambiental en actividades económicas que califiquen como ambientalmente sostenibles según la taxonomía de la UE

con un objetivo medioambiental en actividades económicas que no califican como ambientalmente sostenibles bajo la Taxonomía de la UE

con un objetivo social

Promueve las características de E / S, pero no realizará inversiones sostenibles.

Inversión sostenible significa una inversión en una actividad económica que contribuye a un objetivo medioambiental o social, siempre que la inversión no cause un perjuicio significativo a ningún objetivo medioambiental o social y que las empresas en las que se invierte sigan prácticas de buena gobernanza.

La **taxonomía de la UE** es un sistema de clasificación previsto en el Reglamento (UE) 2020/852 por el que se establece una lista de **actividades económicas medioambientalmente sostenibles**. Ese Reglamento no prevé una lista de actividades económicas socialmente sostenibles. Las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental pueden ajustarse, o no, a la taxonomía.



¿Qué características medioambientales o sociales promueve este producto financiero?

Este fondo de inversión (en adelante, el “Fondo”), gestionado por CaixaBank Asset Management SGIIC, SAU (en adelante, “CaixaBank AM” o la “Sociedad Gestora”), promueve características medioambientales o sociales (art. 8 Reglamento (UE) 2019/2088) mediante la réplica del índice EuroStoxx 50 ESG Net Return (SX5TESG), índice que excluye un total del 20% de los componentes del índice EuroStoxx 50 aplicando filtros estandarizados de actividades controvertidas y normas internacionales, además de excluir las compañías con las puntuaciones ASG más bajas, pudiendo para ello superar los límites generales de diversificación.

- ¿Qué indicadores de sostenibilidad se utilizan para medir la consecución de cada una de las características medioambientales o sociales promovidas por este producto financiero?

El Fondo no emplea directamente indicadores de sostenibilidad para medir las características medioambientales o sociales que promueve, ya que dicha medición la realiza el administrador del índice replicado por el fondo.

Los **indicadores de sostenibilidad** miden cómo se alcanzan las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

- ¿Cuáles son los objetivos de las inversiones sostenibles que el producto financiero pretende en parte lograr y de qué forma contribuye la inversión sostenible a dichos objetivos?

Este Fondo no tiene como objetivo realizar “inversiones sostenibles”, según se definen en el artículo 2.17 del Reglamento (UE) 2019/2088 (SFDR).



- ¿De qué manera las inversiones sostenibles que el producto financiero pretende en parte realizar no causan un perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social?

No aplica.



- ¿Tiene en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

No.

- ¿Qué estrategia de inversión sigue este producto financiero?

La estrategia de inversión del Fondo viene determinada por la réplica del índice EuroStoxx 50 ESG Net Return, de manera continua y vinculante, manteniendo una desviación máxima del 2,5%. El Fondo no selecciona directamente las inversiones para promover características medioambientales o sociales, ya que dicha selección la realiza el administrador del índice sostenible que replica el fondo.

Para la construcción del índice sostenible EuroStoxx 50 ESG Net Return, se parte del índice EuroStoxx 50, y se aplican los siguientes criterios excluyentes:

- Valores que no cumplan las principales normas y estándares internacionales: Principios del Pacto Mundial de Naciones Unidas, los Principios Rectores de Naciones Unidas para las Empresas y los Derechos Humanos y las Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales, y sus convecciones subyacentes.
- Compañías involucradas en las siguientes actividades: extracción y/o generación de carbón térmico si la facturación es superior al 5%, armas controvertidas, industria armamentista y producción de tabaco. Si el porcentaje de exclusiones no alcanza el 20% de los componentes del índice de partida, se excluirán las compañías con peores calificaciones ASG hasta alcanzar un total del 20% de los componentes del EuroStoxx 50. Dicha calificación ASG tiene en cuenta un análisis en función de su actividad, sector o área geográfica, de los principales aspectos medioambientales, sociales y de buen gobierno de las compañías. Las compañías excluidas son reemplazadas por compañías del mismo sector con mejores calificaciones ASG, clasificadas según su capitalización de mercado.

La **estrategia de inversión** orienta las decisiones de inversión sobre la base de factores como los objetivos de inversión y la tolerancia al riesgo.

Las prácticas de **buena gobernanza** incluyen las estructuras de buena gestión, las relaciones con los trabajadores, la remuneración del personal y el cumplimiento de las obligaciones fiscales.

Adicionalmente, el Fondo aplica en todas las inversiones la siguiente estrategia de inversión sostenible en el proceso de inversión:

- Se realizan acciones de diálogo y de voto para promover o influir en decisiones específicas en aspectos ASG, conforme a las políticas y procedimientos definidos en la Sociedad Gestora.

- ¿Cuáles son los elementos vinculantes de la estrategia de inversión utilizados para seleccionar las inversiones dirigidas a lograr cada una de las características medioambientales o sociales que promueve este producto financiero?

Tal y como se detalla en la pregunta anterior, el Fondo replica el índice EuroStoxx 50 ESG Net Return, índice bursátil compuesto por los 50 valores de mayor capitalización de los países del área euro, aplicando criterios adicionales de exclusión y de calificación ASG en la selección de valores para conseguir una calificación ASG media de la cartera superior al índice general de mercado EuroStoxx 50.

- ¿Cuál es el porcentaje mínimo comprometido para reducir la magnitud de las inversiones consideradas antes de la aplicación de dicha estrategia de inversión?

No existe un compromiso mínimo para reducir la magnitud de las inversiones consideradas antes de la aplicación de la estrategia de inversión.

- ¿Cuál es la política para evaluar las prácticas de buena gobernanza de las empresas en las que invierte?

Tal y como se detalla en la sección "¿Qué estrategia de inversión sigue este producto financiero?" las decisiones de inversión del Fondo se basan en la réplica del índice EuroStoxx 50 ESG Net Return. Por lo tanto, el Fondo no selecciona directamente las inversiones para promover características medioambientales o sociales y la Sociedad Gestora no realiza directamente evaluaciones de las prácticas de buena gobernanza de las empresas en las que invierte el Fondo.



¿Cuál es la asignación de activos prevista para este producto financiero?

EL Fondo réplica el índice EuroStoxx 50 ESG Net Return, de manera continua y vinculante, manteniendo una desviación máxima del 2,5%.

En la gestión de este Fondo se incluyen inversiones bajo la categoría “nº 2 Otras” con el objetivo de mantener niveles de inversión acordes con la política de inversión definida y la gestión de la liquidez.

La Sociedad Gestora informará del porcentaje real en el documento de información periódica aplicable a cada período de referencia.



- ¿Cómo logra el uso de derivados las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero?

La operativa con derivados no contribuirá a la consecución de las características ambientales o sociales que promueve este fondo.



¿En qué medida, como mínimo, se ajustan las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental de la taxonomía de la UE?

No aplica



¿Cuál es la proporción mínima de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que no se ajustan a la taxonomía de la UE?

No aplica.



¿Cuál es la proporción mínima de inversiones socialmente sostenibles?

No aplica.



¿Qué inversiones se incluyen en el “nº 2 Otras” y cuál es su propósito? ¿Existen garantías medioambientales o sociales mínimas?

En la gestión de este Fondo se incluyen inversiones bajo la categoría “nº 2 Otras” con el objetivo de mantener niveles de inversión acordes con la política de inversión definida y la gestión de la liquidez.



¿Se ha designado un índice específico como índice de referencia para determinar si este producto financiero está en consonancia con las características medioambientales o sociales que promueve?

El Fondo sigue como índice de referencia el EuroStoxx 50 ESG Net Return (SX5TESG), índice bursátil compuesto por los 50 valores de mayor capitalización de los países del área euro, aplicando criterios adicionales de exclusión y de calificación ASG en la selección de valores para conseguir una calificación ASG media de la cartera superior al índice general de mercado EuroStoxx 50.

- ¿Cómo se ajusta de forma continua el índice de referencia a cada una de las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero?

Se consigue que el índice de referencia se ajuste de forma continua a las características medioambiental y/o sociales que promueve el Fondo aplicando los criterios adicionales de exclusión y de calificación ASG en la selección de valores.

- ¿Cómo se garantiza el ajuste de la estrategia de inversión con la metodología del índice de manera continua?

Para el seguimiento del índice se emplearán tanto el modelo de réplica física (acciones) como el de réplica sintética (a través de futuros y/ ETFs), seleccionando en cada momento las acciones e instrumentos sintéticos más adecuados en opinión de la Gestora según las condiciones del mercado y el patrimonio del Fondo. La cartera (ya sea física o sintética) implicará, para los partícipes del Fondo, una elevada exposición a la evolución del índice subyacente, aunque factores tales como la selección de las acciones utilizadas, las comisiones soportadas por el Fondo, los costes de transacción en los que se incurren para formar la cartera del Fondo así como la reinversión de los dividendos de las acciones incluidas en la cartera del Fondo en cada momento pueden afectar a la capacidad del Fondo para seguir el comportamiento del índice, si bien la desviación máxima con el índice de referencia será del 2,5%. En cualquier caso, el modelo seleccionado tendrá siempre como objetivo una gestión más eficiente del Fondo, así como la minimización de los costes operativos soportados.

Los índices de referencia son índices que miden si el producto financiero logra las características medioambientales o sociales que promueve.

- [¿Cómo difiere el índice designado de un índice general de mercado pertinente?](#)

El índice sostenible replicado difiere del índice general de mercado del que se deriva en que aplica criterios de selección de valores, mediante determinados filtros de exclusión, tal y como se indica en la sección de “¿Qué estrategia de inversión sigue este producto financiero?”.

- [¿Dónde puede encontrarse la metodología utilizada para el cálculo del índice designado?](#)

El administrador del índice es Qontigo GmbH, sociedad de Deutsche Börse Group, que se encarga de su difusión. Tanto la composición del índice replicado como la metodología de cálculo utilizada pueden ser consultadas en: [EURO STOXX 50® ESG - Qontigo](#)

El administrador de dicho índice está incluido en el registro previsto en la regulación europea aplicable.



[¿Dónde puedo encontrar en línea más información específica sobre el producto?](#)

- La composición del índice replicado y la metodología del cálculo, la puede encontrar en:
<https://qontigo.com/index/sx5eesg/>

Puede encontrarse más información específica sobre el producto en el sitio web:

- https://www.caixabankassetmanagement.com/sites/default/files/informacion-legal/TCS_0090661_CAIXABANK-BOLSA-INDICE-EURO-FI-CLASE-CARTERA_CAS.pdf
- https://www.caixabankassetmanagement.com/sites/default/files/informacion-legal/TCS_0090284_CAIXABANK-BOLSA-INDICE-EURO-FI-C-INSTITUC-PLUS_CAS.pdf
- https://www.caixabankassetmanagement.com/sites/default/files/informacion-legal/TCS_0090662_CAIXABANK-BOLSA-INDICE-EURO-FI-CLASE-EXTRA_CAS.pdf