

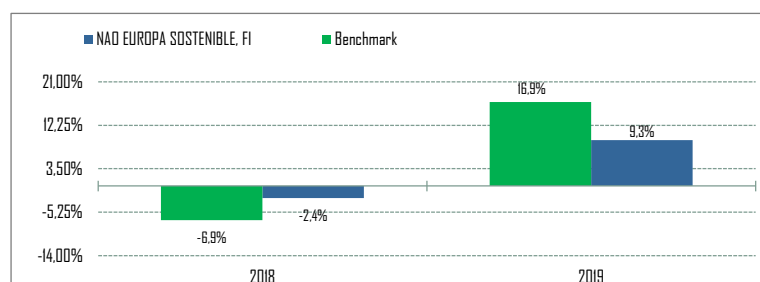
NAO EUROPA SOSTENIBLE, FI

AGOSTO DE 2019

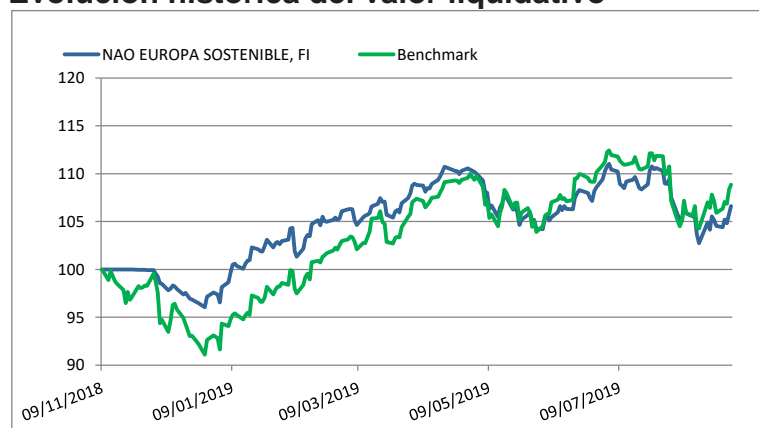
Características del fondo

Nombre	NAO EUROPA SOSTENIBLE, FI
Nº Registro CNMV	5313
Categoría CNMV	Renta Variable Internacional
Horizonte temporal	5 años
Divisa	EUR
Fecha de registro	09/11/2018
Patrimonio Total (miles)	7.883,46
Índice de referencia (Benchmark)	EUROSTOXX50 NET RETURN
Periodicidad del VL	Diario
Hora límite de introducción de órdenes	Antes de las 14:00h
Entidad Gestora	Nao Asset Management, E.S.G. SGIIC, S.A.
Entidad Depositaria	BNP Paribas Securities Services
Auditor	Deloitte, S.L.
Enlace web Gestora	www.nao-sam.com

Rendimiento anual vs Benchmark



Evolución histórica del valor liquidativo



Rendimientos mensuales

Año	Ene.	Feb.	Mar.	Abr.	May.	Jun.	Jul.	Ago.	Sep.	Oct.	Nov.	Dic.	Anual
2019	2,64%	2,61%	1,52%	3,31%	-5,62%	4,16%	0,34%	-2,13%	-	-	-	-	9,26%
2018	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-0,07%	-2,34%	-2,41%

Nivel de riesgo¹

1	2	3	4	5	6	7
Riesgo menor					Riesgo mayor	

¹ Este indicador se basa en la volatilidad de los precios en los últimos cinco años, y es un indicador de riesgo absoluto. Los datos históricos pueden no ser un indicador fiable del futuro perfil de riesgo del Fondo. La categoría de riesgo indicada no está garantizada y puede variar a lo largo del tiempo. La calificación más baja no significa que la inversión esté libre de riesgos.

Objetivo

NAO Europa Sostenible, F.I. busca lograr una revalorización del capital a medio y largo plazo a través de la inversión en empresas que cumplan nuestros criterios financieros y criterios de sostenibilidad. Serán principalmente inversiones en empresas

Clases de participaciones

	CLASE D	CLASE M
ISIN	ES0165283005	ES0165283021
Valor Liquidativo	10,66	10,01
Com. Gestión	0,70%	1,50%
Com. Depositario	0,07%	0,07%
TER ²	0,85%	1,90%
Inversión Mínima	Cerrada a nuevas suscripciones	1.000 €
Fecha Creación	09/11/2018	01/03/2019

² Los gastos corrientes son los soportados por el fondo en el ejercicio precedente. No obstante, este importe podrá variar de un año a otro. Datos actualizados según el último informe anual disponible.

Estadísticas

Rentabilidades	Estadísticas Rentabilidad / Riesgo		
Total desde Inicio	6,62%	Mayor subida mensual	5,17%
Acumulada año 2019	9,26%	Mayor caída mensual	-5,62%
Último mes	-2,13%	% Meses en positivo	60,00%
3 Últimos meses	1,36%	Volatilidad del Fondo	10,28%
12 Últimos meses	-	Volatilidad del Benchmark	14,45%
3 años (anualizada)	-	Beta	0,60
5 años (anualizada)	-	Correlación	0,84
		R2	0,71
		Alpha	1,75
		Ratio Sharpe	0,80
		Tracking Error	8,00%
		Ratio Información	-0,32

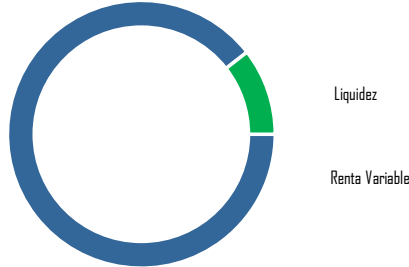
* El fondo ha empezado a desarrollar su política de inversión actual el 09/11/18 por lo que no están disponibles las rentabilidades anteriores a esa fecha.

Datos a 30 de Agosto de 2019

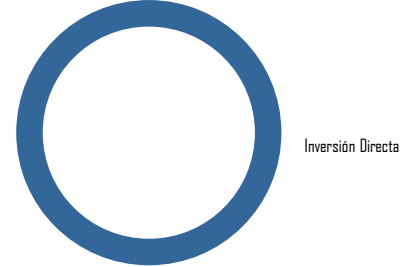
NAO EUROPA SOSTENIBLE, FI

Composición por tipo de activo

Tipo de Activo (fondo vs benchmark)	Fondo	Benchmark
Renta Variable	89,5%	100,0%
Liquidez	10,5%	0,0%
TOTAL	100,0%	100,0%



Tipo de Activo (inv.directa vs fondos)	Inv. Directa	Inv. Fondos
Renta Variable	89,5%	-
Liquidez	10,5%	-
TOTAL	100,0%	-



10 Principales posiciones

Instrumento financiero	A. Geográfica	% Patrim
Mayr Melnhof Karton AG	Austria	7,5%
Prysmian SpA	Italia	5,8%
Inditex SA	España	5,0%
Sanofi-Aventis SA	Francia	4,8%
Construcciones y Auxiliar de F	España	4,5%
Engie S.A. (GDF Suez)	Francia	4,4%
Novartis AG	Suiza	4,2%
Henkel AG & Co KGaA	Alemania	4,0%
Stora Enso OYJ	Finlandia	4,0%
Michelin	Francia	3,5%
TOTAL		47,6%

Distribución por sectores

Sector	% Patrim
Industrial	31,4%
Química	14,8%
Prod. Consumo No Básico	14,7%
Salud	13,3%
Prod. Primera Necesidad	6,2%
Serv. Utilidad Pública	4,6%
Tecnología Información	2,5%
Finanzas	1,8%

Distribución por A. Geográfica

A. Geográfica	% Patrim
Francia	24,6%
España	11,4%
Alemania	11,2%
Suiza	10,9%
Otros	31,4%

Distribución por divisa

Divisa	RV	RF	LQ	IA	TOTAL
EUR	78,0%	0,0%	10,5%	0,0%	88,5%
CHF	10,9%	0,0%	0,0%	0,0%	10,9%
GBP	0,5%	0,0%	0,0%	0,0%	0,5%

Las rentabilidades pasadas no garantizan rentabilidades futuras. El valor de las inversiones y de sus rendimientos pueden variar y el inversor puede no recuperar su inversión original. Este documento es informativo y no supone recomendación u oferta para suscribir participaciones. NAO está inscrita en la CNMV con el número 287.

Antes de toda suscripción o compra se recomienda leer también el folleto más reciente y consultar el último informe financiero publicado. Toda esta información está disponible gratuitamente en el domicilio de la sociedad Gestora NAO ASSET MANAGEMENT, E.S.G., S.G.L.L.C., S.A. (PLAZA AYUNTAMIENTO, 27 PLANTA 7 - 46002 - VALENCIA) o contactando en el teléfono 960 454 015 o en el correo info@nao-sam.com. Asimismo pueden consultarse en la página web www.nao-sam.com, y en la CNMV.