

NAO EUROPA RESPONSABLE FI

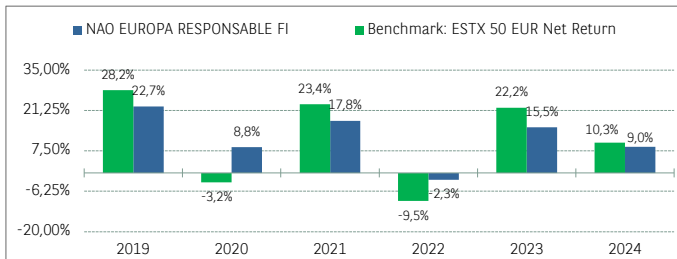
JUNIO DE 2024

Comunicación de Marketing

Características del fondo

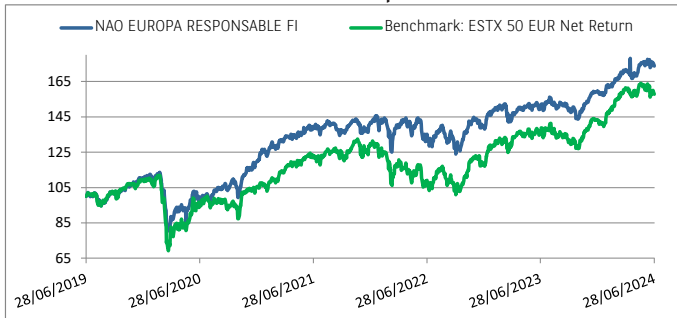
Nombre	NAO EUROPA RESPONSABLE FI
Nº Registro CNMV	5313
Categoría CNMV	Renta Variable Internacional
Horizonte temporal	4 años
Divisa	EUR
Fecha de registro	09/11/2018
Patrimonio Total (miles)	17.940,68
Índice de referencia (Benchmark)	EUROSTOXX50 NET RETURN
Periodicidad del VL	Diario
Hora límite de introducción de órdenes	Antes de las 14:00h
Entidad Gestora	Nao Asset Management, E.S.G. SGIIC, S.A.
Entidad Depositaria	BANKINTER, S. A.
Auditor	Deloitte, S.L.
Enlace web Gestora	www.nao-sam.com
Clasificación Sostenibilidad (SFDR)	Artículo 8

Rendimiento anual vs Benchmark



Fuente: VL del fondo calculados por la Sociedad; Datos Benchmark obtenidos de Bloomberg

Evolución histórica del valor liquidativo



Fuente: VL del fondo calculados por la Sociedad; Datos Benchmark obtenidos de Bloomberg

Rendimientos mensuales

Año	Ene.	Feb.	Mar.	Abr.	May.	Jun.	Jul.	Ago.	Sep.	Oct.	Nov.	Dic.	Anual
2024	2,04%	2,22%	3,21%	-2,03%	3,90%	-0,58%	-	-	-	-	-	-	8,96%
2023	7,73%	1,56%	-2,47%	1,96%	-0,91%	2,21%	2,25%	-1,80%	-1,86%	-3,08%	6,22%	3,35%	15,55%
2022	0,23%	-3,55%	1,89%	2,31%	0,33%	-8,05%	4,04%	-3,46%	-4,68%	8,16%	5,25%	-3,59%	-2,30%
2021	2,29%	3,26%	5,46%	-0,15%	1,86%	1,85%	0,25%	1,37%	-2,75%	3,79%	-4,40%	4,09%	17,78%
2020	-1,68%	-6,16%	-12,98%	6,07%	3,88%	1,17%	-0,76%	6,24%	0,76%	-4,46%	14,84%	4,30%	8,80%

El rendimiento pasado no es una guía del rendimiento futuro. La rentabilidad futura está sujeta a fiscalidad que depende de la situación personal de cada inversor y que puede cambiar en el futuro.

Datos a 28 de Junio de 2024

Nivel de riesgo¹

1	2	3	4	5	6	7
Riesgo menor				Riesgo mayor		

¹ Este perfil de riesgo actual se basa en datos históricos. 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 cotizadas europeas, sin excluir valores de otros países de la OCDE.

La información de riesgos está disponible en los KIID.

* Los datos económicos (gráficos, rentabilidades y datos estadísticos) corresponden a la CLASE D

Clases de participaciones

	CLASE D	CLASE M
ISIN	ES0165283005	ES0165283021
Valor Liquidativo	18,87	17,08
Com. Gestión	0,70%	1,50%
Com. Depositario	0,07%	0,07%
TER ²	0,85%	1,67%
Inversión Mínima	Cerrada a nuevas suscripciones	1 participación
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.

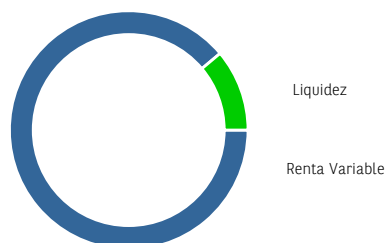
Estadísticas

Rentabilidades	Estadísticas Rentabilidad / Riesgo		
Total desde inicio	88,69%	Mayor subida mensual	14,84%
Acumulada año 2024	8,96%	Mayor caída mensual	-12,98%
Último mes	-0,58%	% Meses en positivo	64,71%
3 Últimos meses	1,21%	Volatilidad del Fondo	11,65%
12 Últimos meses	14,25%	Volatilidad del Benchmark	12,24%
3 años (anualizada)	7,88%	Beta	0,66
5 años (anualizada)	11,69%	Correlación	0,69
		R2	0,47
		Alpha	3,99
		Ratio Sharpe	1,09
		Tracking Error	9,44%
		Ratio Información	-0,06

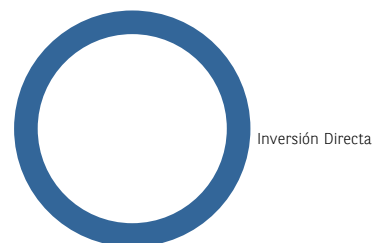
NAO EUROPA RESPONSABLE FI

Composición por tipo de activo

Tipo de Activo (fondo vs benchmark)	Fondo	Benchmark
Renta Variable	88,9%	100,0%
Liquidez	11,1%	0,0%
TOTAL	100,0%	100,0%



Tipo de Activo (Inv.directa vs fondos)	Inv. Directa	Inv. Fondos
Renta Variable	88,9%	-
Liquidez	11,1%	-
TOTAL	100,0%	-



10 Principales posiciones

Instrumento financiero	A. Geográfica	% Patrim
ASML Holding NV	Países Bajos	4,9%
Novartis AG	Suiza	4,8%
Intesa Sanpaolo SpA	Italia	4,8%
Allianz SE	Alemania	4,7%
Inditex SA	España	4,0%
Schneider Electric SA	Francia	3,8%
Microsoft Corp EUR	Estados Unidos	3,3%
Sika AG	Suiza	3,1%
Legrand SA	Francia	3,1%
Unilever PLC EUR	Reino Unido	3,1%
TOTAL		39,5%

Distribución por sectores

Sector	% Patrim
Tecnología Información	16,4%
Finanzas	14,1%
Química	14,0%
Industrial	13,9%
Prod. Consumo No Básico	13,8%
Prod. Primera Necesidad	8,9%
Salud	7,7%

Distribución por A. Geográfica

A. Geográfica	% Patrim
Francia	20,8%
Suiza	14,8%
Alemania	10,3%
Países Bajos	9,5%
Otros	33,4%

Distribución por divisa

Divisa	RV	RF	LQ	IA	TOTAL
EUR	66,0%	0,0%	11,1%	0,0%	77,1%
CHF	14,8%	0,0%	0,0%	0,0%	14,8%
USD	4,2%	0,0%	0,0%	0,0%	4,2%
SEK	2,6%	0,0%	0,0%	0,0%	2,6%
NOK	1,2%	0,0%	0,0%	0,0%	1,2%

Características que promueve este fondo

El Fondo promueve una serie de características medioambientales y sociales a través de la inversión en compañías que presenten unos elevados estándares de sostenibilidad con respecto a sus prácticas empresariales. A continuación, se describen cada una de ellas:

- Medioambientales: reducción de las emisiones de gases de efecto invernadero, reducción del consumo de agua, reducción de las emisiones de energía consumida, promoción del uso de energías renovables y gestión medioambiental (climática, de recursos naturales y de residuos) eficiente.
- Sociales: igualdad entre hombres y mujeres en el entorno laboral, aplicación de prácticas sostenibles a lo largo de la cadena de valor, desarrollo de productos y servicios responsables y establecimiento de prácticas para la protección de los empleados.

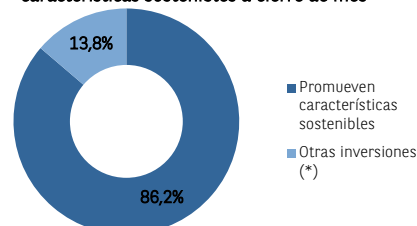
El favorecimiento de estas características se lleva a cabo teniendo en cuenta en todo momento que se deben cumplir unas salvaguardas mínimas en cuanto a prácticas de buen gobierno de la compañía y respeto por los principios y normas de comportamiento.

No se ha designado ningún punto de referencia con el fin de alcanzar las características ambientales o sociales promovidas por el Compartimento.

Compromiso

El Fondo se compromete a invertir al menos el 75% de los activos netos del fondo en inversiones que promuevan las características medioambientales y sociales definidas. Sin embargo, no se compromete a realizar ninguna inversión sostenible, ni de carácter ambiental ni social. Tampoco se compromete a realizar ninguna inversión sostenible de acuerdo a la Taxonomía UE.

Distribución inversiones que promueven características sostenibles a cierre de mes



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 267. 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.I.I.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.