

# CAIXABANK BOLSA INDICE ESPAÑA, FI

Informe Segon semestre 2024

Núm. registre CNMV: 1878

Data de registre: 21/07/1999

Gestora: CaixaBank Asset Management SGIC, S.A.

Dipositari: CECABANK

Grup Gestora/Dipositari: CaixaBank SA / CECA

Ràting Dipositari: BBB+

Auditor: DELOITTE, S.L.

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

L'entitat gestora atén les consultes dels clients, relacionades amb les IIC gestionades a Paseo de la Castellana, 189 Madrid tel.900103368, 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: 5 (En una escala del 1 al 7)

**DESCRIPCIÓ GENERAL:** Fons de renda variable que replica l'Índex borsari espanyol IBEX-35.

**OPERACIONS EN INSTRUMENTS DERIVATS:** El fons ha dut a terme operacions amb instruments derivats amb la finalitat d'inversió per gestionar la cartera d'una manera més eficaç. La metodologia aplicada per calcular l'exposició total al risc és la metodologia del compromís. Es pot trobar informació més detallada sobre la política d'inversió del fons al fulllet informatiu. 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 fulllet 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	0,00	0,00	0,00	0,00
Rendibilitat mitjana de la liquiditat (% anualitzat)	3,41	3,94	3,68	2,63

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 ESPAÑA, 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	3.682.069,20	3.882.283,87	Període	43.374	11,7798	Comissió de gestió	0,50	1,00	Patrimoni
Nº de partícips	2.457	2.507	2023	41.374	9,9445	Comissió de resultats	0,00	0,00	Resultats
Benef. bruts distrib. per particip. (Euros)	0,00	0,00	2022	18.278	7,8627	Comissió de gestió total	0,50	1,00	Mixta
			2021	20.361	8,1069	Comissió de dipositari	0,01	0,02	Patrimoni

Inversió mínima: 600 EUR

#### CAIXABANK BOLSA INDICE ESPAÑA, 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	1.521.418,64	1.527.917,58	Període	13.212	8,6839	Comissió de gestió	0,38	0,75	Patrimoni
Nº de partícips	48	47	2023	11.196	7,3128	Comissió de resultats	0,00	0,00	Resultats
Benef. bruts distrib. per particip. (Euros)	0,00	0,00	2022	3.391	5,7676	Comissió de gestió total	0,38	0,75	Mixta
			2021	3.553	5,9319	Comissió de dipositari	0,01	0,02	Patrimoni

Inversió mínima: 150000 EUR

#### CAIXABANK BOLSA INDICE ESPAÑA, 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	20.291.446,21	22.357.558,25	Període	263.476	12,9846	Comissió de gestió	0,05	0,11	Patrimoni
Nº de partícips	3	3	2023	281.875	10,8653	Comissió de resultats	0,00	0,00	Resultats
Benef. bruts distrib. per particip. (Euros)	0,00	0,00	2022	253.976	8,5149	Comissió de gestió total	0,05	0,11	Mixta
			2021	254.964	8,7014	Comissió de dipositari	0,01	0,02	Patrimoni

Inversió mínima: 50000000 EUR

#### CAIXABANK BOLSA INDICE ESPAÑA, FI CLASE PLATINUM

	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	875.640,50	946.840,14	Període	7.994	9,1297	Comissió de gestió	0,13	0,26	Patrimoni
Nº de partícips	3	6	2023	7.123	7,6511	Comissió de resultats	0,00	0,00	Resultats
Benef. bruts distrib. per particip. (Euros)	0,00	0,00	2022	4.522	6,0051	Comissió de gestió total	0,13	0,26	Mixta
			2021	5.176	6,1459	Comissió de dipositari	0,01	0,02	Patrimoni

Inversió mínima: 1000000 EUR

#### CAIXABANK BOLSA INDICE ESPAÑA, FI CLASE SIN RETRO

	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	233.869,16	246.826,97	Període	2.164	9,2525	Comissió de gestió	0,05	0,11	Patrimoni
Nº de partícips	26	30	2023	1.871	7,7424	Comissió de resultats	0,00	0,00	Resultats
Benef. bruts distrib. per particip. (Euros)	0,00	0,00	2022	1.157	6,0675	Comissió de gestió total	0,05	0,11	Mixta
			2021	271	6,2005	Comissió de dipositari	0,01	0,02	Patrimoni

Inversió mínima:

### 2.2. COMPORTAMENT

## 2.2.1 Individual - CAIXABANK BOLSA INDICE ESPAÑA, FI. Divisa EUR

Rendibilitat (% anualitzat)

### CAIXABANK BOLSA INDICE ESPAÑA, FI CLASE ESTANDAR

	Acumulat any actual	Trimestral				Anual			
		31-12-24	30-09-24	30-06-24	31-03-24	2023	2022	2021	2019
Rendibilitat	18,46	-1,55	9,10	0,05	10,24	26,48	-3,01	9,59	15,19
<b>Rendibilitats extremes*</b>		Trimestre actual		Últim any		Últims 3 anys			
		%	Data	%	Data	%	Data	%	Data
Rendibilitat mínima (%)		-2,82	06-11-24	-2,82	06-11-24	9,10	26-11-21		
Rendibilitat màxima (%)		1,55	05-12-24	2,00	07-08-24	4,86	09-03-22		

### CAIXABANK BOLSA INDICE ESPAÑA, FI CLASE EXTRA

	Acumulat any actual	Trimestral				Anual			
		31-12-24	30-09-24	30-06-24	31-03-24	2023	2022	2021	2019
Rendibilitat	18,75	-1,49	9,16	0,11	10,31	26,79	-2,77	9,87	
<b>Rendibilitats extremes*</b>		Trimestre actual		Últim any		Últims 3 anys			
		%	Data	%	Data	%	Data	%	Data
Rendibilitat mínima (%)		-2,82	06-11-24	-2,82	06-11-24	9,16	26-11-21		
Rendibilitat màxima (%)		1,55	05-12-24	2,00	07-08-24	4,86	09-03-22		

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

	Acumulat any actual	Trimestral				Anual			
		31-12-24	30-09-24	30-06-24	31-03-24	2023	2022	2021	2019
Rendibilitat	19,51	-1,33	9,34	0,27	10,48	27,60	-2,14	10,57	16,32
<b>Rendibilitats extremes*</b>		Trimestre actual		Últim any		Últims 3 anys			
		%	Data	%	Data	%	Data	%	Data
Rendibilitat mínima (%)		-2,81	06-11-24	-2,81	06-11-24	9,34	26-11-21		
Rendibilitat màxima (%)		1,55	05-12-24	2,00	07-08-24	4,86	09-03-22		

### CAIXABANK BOLSA INDICE ESPAÑA, FI CLASE PLATINUM

	Acumulat any actual	Trimestral				Anual			
		31-12-24	30-09-24	30-06-24	31-03-24	2023	2022	2021	2019
Rendibilitat	19,33	-1,37	9,30	0,23	10,44	27,41	-2,29	10,40	
<b>Rendibilitats extremes*</b>		Trimestre actual		Últim any		Últims 3 anys			
		%	Data	%	Data	%	Data	%	Data
Rendibilitat mínima (%)		-2,81	06-11-24	-2,81	06-11-24	9,30	26-11-21		
Rendibilitat màxima (%)		1,55	05-12-24	2,00	07-08-24	4,86	09-03-22		

### CAIXABANK BOLSA INDICE ESPAÑA, FI CLASE SIN RETRO

	Acumulat any actual	Trimestral				Anual			
		31-12-24	30-09-24	30-06-24	31-03-24	2023	2022	2021	2019
Rendibilitat	19,50	-1,33	9,34	0,27	10,48	27,60	-2,14	10,57	
<b>Rendibilitats extremes*</b>		Trimestre actual		Últim any		Últims 3 anys			
		%	Data	%	Data	%	Data	%	Data
Rendibilitat mínima (%)		-2,81	06-11-24	-2,81	06-11-24	9,34	26-11-21		
Rendibilitat màxima (%)		1,55	05-12-24	2,00	07-08-24	4,86	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			
		31-12-24	30-09-24	30-06-24	31-03-24	2023	2022	2021	2019
<b>Volatilitat * de:</b>									
Ibex-35 Net TR	13,26	12,94	13,94	14,40	11,63	13,92	19,30	16,23	12,40
Letra Tesoro 1 año	0,11	0,04	0,12	0,12	0,12	0,11	0,07	0,02	0,25
Ibex 35 NetR (Open) 100%	13,26	12,94	13,94	14,40	11,63	13,92	19,30	16,23	12,40

### CAIXABANK BOLSA INDICE ESPAÑA, FI CLASE ESTANDAR

	Acumulat any actual	Trimestral				Anual			
		31-12-24	30-09-24	30-06-24	31-03-24	2023	2022	2021	2019
<b>Volatilitat * de:</b>									
Valor Liquidatiu	13,19	12,72	14,00	14,27	11,63	13,99	19,58	16,30	12,39
VaR històric **	15,30	15,30	15,30	15,30	15,30	15,30	15,30	15,30	9,01

### CAIXABANK BOLSA INDICE ESPAÑA, FI CLASE EXTRA

	Acumulat any actual	Trimestral				Anual			
		31-12-24	30-09-24	30-06-24	31-03-24	2023	2022	2021	2019
<b>Volatilitat * de:</b>									
Valor Liquidatiu	13,19	12,72	14,00	14,27	11,63	13,99	19,58	16,30	
VaR històric **	15,28	15,28	15,28	15,28	15,28	15,77	17,74	19,71	

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

	Acumulat any actual	Trimestral				Anual			
		31-12-24	30-09-24	30-06-24	31-03-24	2023	2022	2021	2019
<b>Volatilitat * de:</b>									
Valor Liquidatiu	13,19	12,72	14,00	14,27	11,63	13,99	19,58	16,30	12,39
VaR històric **	15,23	15,23	15,23	15,23	15,23	15,23	15,23	15,23	8,89

\* 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 LIC dels últims 5 anys. La dada és a finals del període de referència.

Volatilitat * de:	Acumulat any actual	Trimestral				Anual			
		31-12-24	30-09-24	30-06-24	31-03-24	2023	2022	2021	2019
Ibex-35 Net TR	13,26	12,94	13,94	14,40	11,63	13,92	19,30	16,23	12,40
Letra Tesoro 1 año	0,11	0,04	0,12	0,12	0,12	0,11	0,07	0,02	0,25
Ibex 35 NetR (Open) 100%	13,26	12,94	13,94	14,40	11,63	13,92	19,30	16,23	12,40

#### CAIXABANK BOLSA INDICE ESPAÑA, FI CLASE PLATINUM

Volatilitat * de:	Acumulat any actual	Trimestral				Anual			
		31-12-24	30-09-24	30-06-24	31-03-24	2023	2022	2021	2019
Valor Liquidatiu	13,19	12,72	14,00	14,27	11,63	13,99	19,58	16,30	
VaR històric **	15,24	15,24	15,24	15,24	15,57	16,06	18,03	19,99	

#### CAIXABANK BOLSA INDICE ESPAÑA, FI CLASE SIN RETRO

Volatilitat * de:	Acumulat any actual	Trimestral				Anual			
		31-12-24	30-09-24	30-06-24	31-03-24	2023	2022	2021	2019
Valor Liquidatiu	13,19	12,72	14,00	14,27	11,63	13,99	19,58	16,30	
VaR històric **	15,23	15,23	15,23	15,23	15,56	16,05	18,01	19,98	

\* 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 ESPAÑA, FI

Ràtio total de despeses *	Acumulat any actual	Trimestral				Anual			
		31-12-24	30-09-24	30-06-24	31-03-24	2023	2022	2021	2019
CLASE ESTANDAR	1,03	0,26	0,26	0,26	0,26	1,03	1,03	1,03	1,15
CLASE EXTRA	0,78	0,19	0,20	0,19	0,19	0,78	0,78	0,78	0,60
CAIXABANK BOLSA INDICE ESPAÑA, FI C INSTITUC PLUS	0,14	0,03	0,03	0,03	0,03	0,14	0,14	0,14	0,16
CLASE PLATINUM	0,29	0,07	0,07	0,07	0,07	0,29	0,29	0,29	0,18
CLASE SIN RETRO	0,14	0,03	0,03	0,03	0,03	0,14	0,14	0,14	0,09

\* Inclou totes les despeses directes que hi ha hagut en el període de referència: comissió de gestió sobre patrimoni, comissió de dipositaris, 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

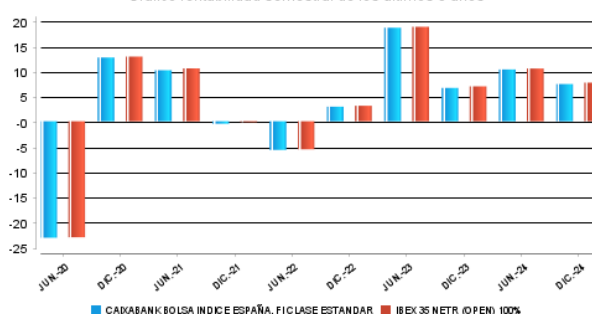
##### CAIXABANK BOLSA INDICE ESPAÑA, FI CLASE ESTANDAR

Gráfico evolución valor liquidativo últimos 5 años



#### Rendibilitat semestral dels últims 5 anys

Gráfico rentabilidad semestral de los últimos 5 años



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

Gráfico evolución valor liquidativo últimos 5 años

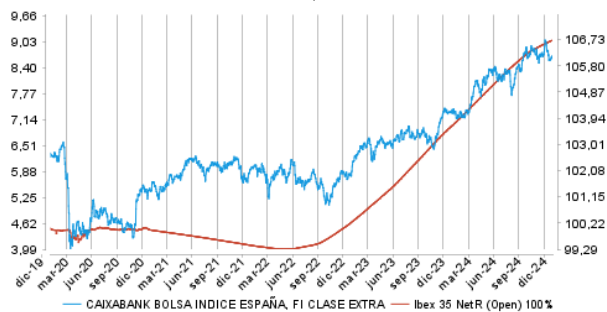
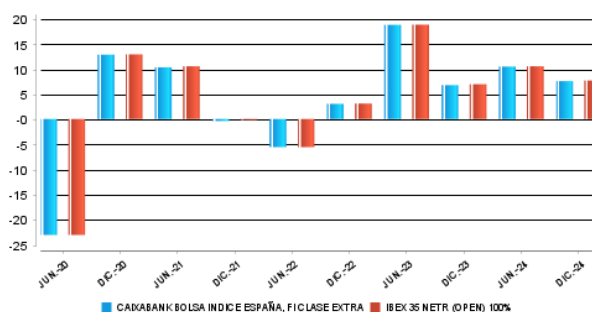


Gráfico rentabilidad semestral de los últimos 5 años



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

Gráfico evolución valor liquidativo últimos 5 años

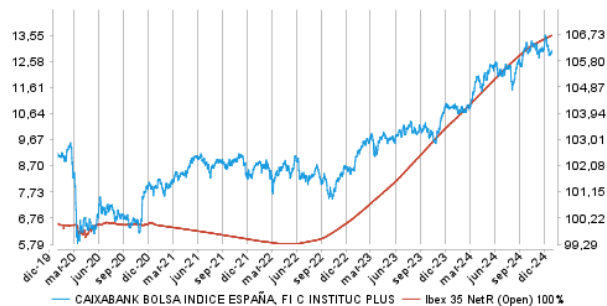
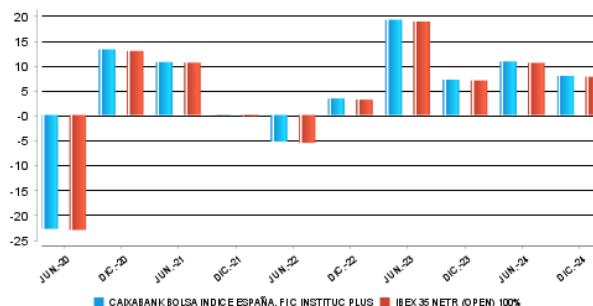


Gráfico rentabilidad semestral de los últimos 5 años



### CAIXABANK BOLSA INDICE ESPAÑA, FI CLASE PLATINUM

Gráfico evolución valor liquidativo últimos 5 años

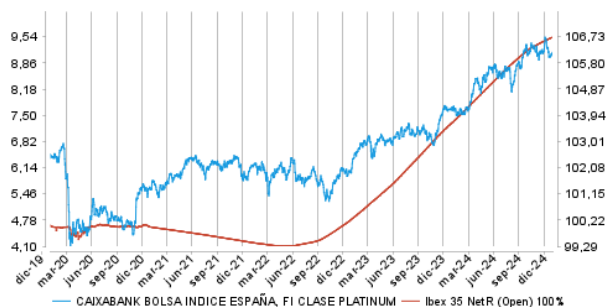
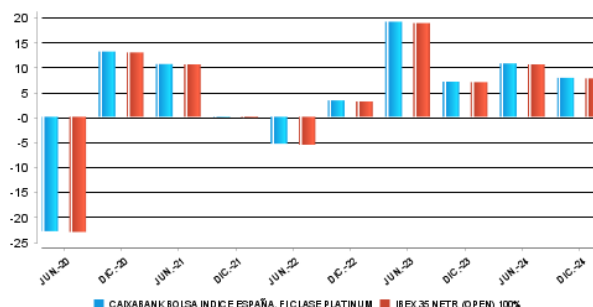


Gráfico rentabilidad semestral de los últimos 5 años



### CAIXABANK BOLSA INDICE ESPAÑA, FI CLASE SIN RETRO

Gráfico evolución valor liquidativo últimos 5 años

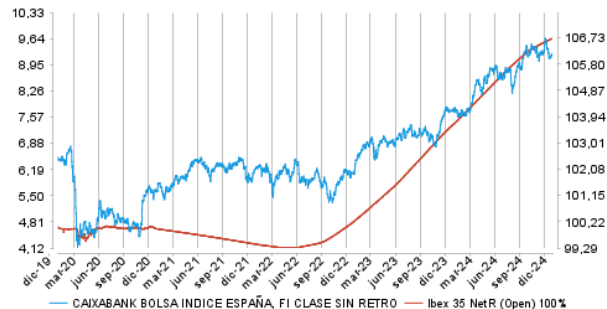
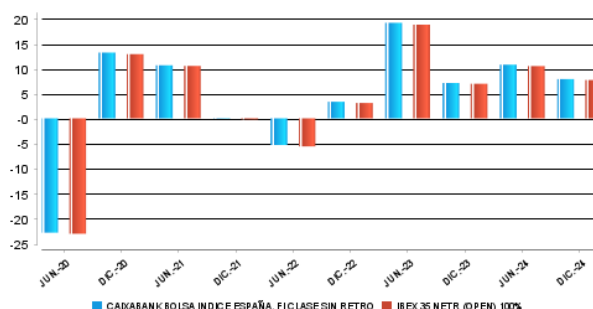


Gráfico rentabilidad semestral de los últimos 5 años



## 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	28.956.647	1.725.450	3,13
Renda fixa internacional	3.562.174	616.221	6,14
Renda fixa mixta euro	1.262.321	51.810	3,37
Renda fixa mixta internacional	3.449.093	119.268	3,07
Renda variable mixta euro	0	0	0,00
Renda variable mixta internacional	1.840.617	66.227	3,83
Renda variable euro	728.268	249.798	6,58
Renda variable internacional	17.829.885	1.923.866	6,11
IIC de gestió passiva (I)	0	0	0,00
Garantit de rendiment fix	216.514	9.243	2,13
Garantit de rendiment variable	269.031	13.051	1,87
De garantia parcial	0	0	0,00
Retorn absolut	2.619.828	370.723	3,33
Global	6.683.882	222.245	4,15
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	17.880.257	309.848	1,58
Renda fixa euro curt termini	5.008.175	472.438	2,00
IIC que replica un índex	1.274.327	22.889	5,79
IIC amb objectiu concret de rendibilitat no garantit	325.091	11.881	2,02
<b>Total Fons</b>	<b>91.906.108</b>	<b>6.184.958</b>	<b>3,61</b>

\*Mitjanes.

(I): inclou IIC que reproduïxen 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	310.494	94,03	313.212.852	93,73
* Cartera interior	310.494	94,03	313.193.705	93,73
* Cartera exterior	0	0,00	19.147	0,01
* Interessos cartera inversió	0	0,00	0	0,00
* Inversions dubtoses, moroses o en litigi	0	0,00	0	0,00
(+) LIQUIDITAT (TRESORERIA)	15.102	4,57	16.091.044	4,82
(+/-) RESTA	4.623	1,40	4.847.614	1,45
<b>TOTAL PATRIMONI</b>	<b>330.220</b>	<b>100,00</b>	<b>334.151.510</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>334.152</b>	343.437.227	343.437.227	
± Subscripcions/ reemborsaments (net)	-8,83	-12,86	-21,65	-30,00
Beneficis bruts distribuïts	0,00	0,00	0,00	0,00
± Rendiments nets	7,69	10,11	17,77	-22,46
(+) Rendiments de gestió	7,90	10,35	18,23	-22,15
+ Interessos	0,07	0,09	0,16	-24,68
+ Dividends	1,56	2,08	3,63	-23,43
± Resultats en renda fixa (fetes o no)	0,00	0,00	0,00	-46.587,53
± Resultats en renda variable (fetes o no)	5,94	7,76	13,69	-21,99
± Resultat en dipòsits (fetes o no)	0,00	0,00	0,00	0,00
± Resultat en derivats (fetes o no)	0,33	0,42	0,75	-17,95
± 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	-0,21	-0,24	-0,46	-9,88
- Comissió de gestió	-0,12	-0,12	-0,25	4,07
- Comissió de dipositar	-0,01	-0,01	-0,02	2,99
- Despeses per serveis exteriors	0,00	0,00	0,00	-39,53
- Altres despeses de gestió corrent	0,00	0,00	0,00	-3,74
- Altres despeses repercutides	-0,08	-0,11	-0,19	-26,02
(+) Ingressos	0,00	0,00	0,00	-82,74
+ Comissionis 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	-82,74
<b>PATRIMONI FI PERÍODE ACTUAL (milers d'euros)</b>	<b>330.219.850</b>	<b>334.151.510</b>	<b>330.219.850</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

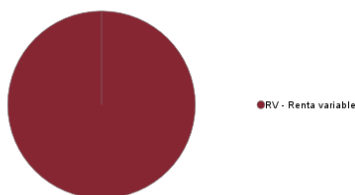
Descripció de la inversió i emissor	Divisa	Període actual		Període anterior	
		Valor de mercat	%	Valor de mercat	%
SOCIMI MERLIN PROPERTIES SO	EUR	3.004	0,91	2.694	0,81
ACCIONES LOGISTA INTEGRAL SA	EUR	1.630	0,49	1.569	0,47
ACCIONES AENA SME SA	EUR	12.396	3,75	12.585	3,77
ACCIONES CELLNEX TELECOM SA	EUR	11.278	3,42	11.977	3,58
ACCIONES CORP ACCIONA ENERGIA	EUR	607	0,18	698	0,21
ACCIONES PUIG BRANDS SA	EUR	1.638	0,50	0	0,00
ACCIONES AMADEUS IT GROUP SA	EUR	16.072	4,87	15.617	4,67
ACCIONES BANCO BILBAO VIZCAYA	EUR	28.489	8,63	30.133	9,02
ACCIONES BANKINTER SA	EUR	3.592	1,09	3.779	1,13
ACCIONES BANCO DE SABADELL SA	EUR	5.336	1,62	5.507	1,65
ACCIONES BANCO SANTANDER SA	EUR	35.407	10,72	38.269	11,45
ACCIONES NATURGY ENERGY GROUP	EUR	2.383	0,72	2.155	0,65
ACCIONES INDRA SISTEMAS SA	EUR	1.582	0,48	1.533	0,46
ACCIONES MAPFRE SA	EUR	2.377	0,72	2.194	0,66
ACCIONES ACCIONA SA	EUR	2.502	0,76	2.669	0,80
ACCIONES ENDESA SA	EUR	4.590	1,39	4.094	1,23
ACCIONES ENAGAS SA	EUR	1.627	0,49	2.006	0,60
ACCIONES ACERINOX SA	EUR	1.241	0,38	1.388	0,42
ACCIONES FLUIDRA SA	EUR	1.418	0,43	1.284	0,38
ACCIONES INMOBILIARIA COLONIA	EUR	687	0,21	983	0,29
ACCIONES CAIXABANK SA	EUR	15.719	4,76	16.277	4,87
ACCIONES IBERDROLA SA	EUR	44.318	13,42	43.430	13,00
ACCIONES INDUSTRIA DE DISENO	EUR	48.602	14,72	48.426	14,49
ACCIONES LABORATORIOS FARMACE	EUR	1.016	0,31	1.554	0,47
ACCIONES SOLARIA ENERGIA Y ME	EUR	521	0,16	820	0,25
ACCIONES ACS ACTIVIDADES DE C	EUR	6.900	2,09	6.102	1,83
ACCIONES GRIFOLS SA	EUR	2.051	0,62	1.847	0,55
ACCIONES REDEIA CORP SA	EUR	4.657	1,41	4.935	1,48

ACCIONES REPSOL SA	EUR	7.202	2,18	10.078	3,02
ACCIONES MELIA HOTELS INTERNA	EUR	0	0,00	745	0,22
ACCIONES INTERNATIONAL CONSOL	EUR	9.463	2,87	5.314	1,59
ACCIONES TELEFONICA SA	EUR	11.671	3,53	12.546	3,75
ACCIONES UNICAJA BANCO SA	EUR	1.363	0,41	1.492	0,45
ACCIONES SACYR SA	EUR	1.300	0,39	1.396	0,42
ACCIONES ARCELORMITTAL SA	EUR	2.002	0,61	2.069	0,62
ACCIONES FERROVIAL SE	EUR	15.732	4,76	15.069	4,51
<b>TOTAL RV COTITZADA</b>		<b>310.371</b>	<b>94,00</b>	<b>313.235</b>	<b>93,77</b>
<b>TOTAL RENDA VARIABLE</b>		<b>310.371</b>	<b>94,00</b>	<b>313.235</b>	<b>93,77</b>
<b>TOTAL INVERSIONS FINANCERES INTERIOR</b>		<b>310.371</b>	<b>94,00</b>	<b>313.235</b>	<b>93,77</b>
DERECHOS ARCELORMITTAL SA	EUR	0	0,00	19	0,01
<b>TOTAL RV COTITZADA</b>		<b>0</b>	<b>0,00</b>	<b>19</b>	<b>0,01</b>
<b>TOTAL RENDA VARIABLE EXT</b>		<b>0</b>	<b>0,00</b>	<b>19</b>	<b>0,01</b>
<b>TOTAL INVERSIONS FINANCERES EXTERIOR</b>		<b>0</b>	<b>0,00</b>	<b>19</b>	<b>0,01</b>
<b>TOTAL INVERSIONS FINANCERES</b>		<b>310.371</b>	<b>94,00</b>	<b>313.255</b>	<b>93,78</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>	
Ibex 35	19.963	Inversió
<b>Total Operativa en Derivats Obligacions Renda Variable</b>	<b>19.963</b>	
<b>Total Operativa en Derivats Obligacions</b>	<b>19.963</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 fullet informatiu	X	
i.Autorització del procés de fusió		X
j.Altres fets rellevants	X	

### 5. ANNEX EXPLICATIU DE FETS RELLEVANTS

H) Verificar i registrar, a sol·licitud de CAIXABANK ASSET MANAGEMENT SGIIC, S.A., com a entitat gestora, i de CECABANK, S.A., com a entitat dipositària, l'actualització del fullet de CAIXABANK BOLSA INDICE ESPAÑA, FI (inscrit en el Registre Administratiu de Fons d'Inversió de caràcter financer amb el número 1878), amb la finalitat de reanomenar la classe CARTERA, que passa a denominar-se classe SENSE RETRO, i modificar el col·lectiu d'inversors d'aquesta mateixa classe.

J) CaixaBank Asset Management SGIIC, S.A.U., entitat gestora d'aquests fons, com a conseqüència de l'avenç de l'hora de tancament habitual del mercat borsari espanyol, informa que, per als dies 24 i 31 de desembre de 2024, les ordres cursades pel participi a partir de les 12.00 hores del migdia es tramitaran juntament amb les que es facin al dia següent hàbil.

### 6. OPERACIONS VINCULADES I ALTRES INFORMACIONS

	Sí	No
a.Participi significatiu 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) En finalitzar el període hi ha 1 participi amb 228.578.180,18 euros, que representen el 69,22 % del patrimoni respectivament.
- d.1) L'import total de les adquisicions durant el període és de 295.547,82 euros. La mitjana de les operacions d'adquisició del període respecte del patrimoni mitjà representa un 0,00 %.
- d.2) L'import total de les vendes durant el període és de 7.489.795,92 euros. La mitjana de les operacions de venda del període respecte del patrimoni mitjà representa un 0,01 %.
- e) L'import total de les adquisicions durant el període és de 758.902,58 euros. La mitjana de les operacions d'adquisició del període respecte al patrimoni mitjà representa un 0,00 %.
- f) L'import total de les adquisicions durant el període és de 130.413,14 euros. La mitjana de les operacions d'adquisició del període respecte al patrimoni mitjà representa un 0,00 %.
- g) Els ingressos percebuts per entitats del grup de la gestora que té com a origen comissions o despeses satisfetes per la IIC en concepte de comissions per intermediació, comissions per rebats, comissions per gestió lliure d'accionistes i comissions per administració, representen un 0,007% sobre el patrimoni mitjà del període.
- h) S'han fet operacions d'adquisició temporal d'actius amb pacte de recompra amb el dipositari, compravenda 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 un 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 FONDS.

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

Durant el segon semestre de 2024, l'economia global ha mostrat signes de desaceleració. Als Estats Units, el creixement del PIB s'ha moderat i ha tancat l'any amb un creixement anual del 2,9 %. La inflació s'ha començat a estabilitzar al voltant del nivell del 2,4 %. A l'eurozona, el creixement ha estat més feble, amb un augment del PIB de l'1,5 %. La Xina ha experimentat un creixement del 4,8 %, afectada per la regulació governamental i un mercat immobiliari que s'està refredant. Els mercats emergents han tingut comportaments diferents, amb alguns països que s'han beneficiat dels preus més alts d'algunes primeres matèries, mentre que uns altres han hagut de fer front a les inestabilitats polítiques. En aquesta segona part de l'any 2024, els bancs centrals han continuat amb les polítiques de relaxament de tipus. La Reserva Federal dels EUA ha reduït els seus tipus fins al 4,5 % des del 5,5 %, i s'ha enfocat a donar suport al creixement econòmic. El Banc Central Europeu, per la seva banda, ha reduït els tipus d'interès al 3 % en aquest segon semestre, amb la qual cosa també pretén estimular l'economia de l'eurozona. En mercats emergents, Turquia ha liderat les baixades de tipus amb una reducció de 250 punts bàsics. El Banc del Japó ha mantingut la seva política monetària ultra laxa per tal d'assolir el seu objectiu d'inflació del 2 %, malgrat haver fet una pujada de tipus el mes de juliol.

Els mercats borsaris, per la seva banda, han tingut un any espectacular, impulsats pel fort creixement econòmic i el canvi de la direcció de la política monetària per part dels principals bancs centrals (llevat del Banc del Japó). El sector tecnològic, i particularment les companyies relacionades amb la intel·ligència artificial, han estat les més beneficiades. Les borses s'han vist reforçades per una combinació d'una progressiva reducció de la inflació, la flexibilització monetària, la fortalesa de l'economia dels EUA i l'optimisme sobre la comercialització i expansió del negoci de la intel·ligència artificial.

A Europa, l'índex EuroStoxx 50 ha tancat pràcticament pla (+0,04 %) durant el semestre i l'índex ESG ha tingut comportament una mica inferior (-0,07 %). A l'eurozona, la disparitat de comportament de les bosses durant la segona meitat de l'any ha estat elevada: el CAC 40 va caure un -1,32 %, mentre que el DAX alemany va pujar un 9,18 % fet que reflecteix una expectativa de consolidació de la producció industrial, juntament amb el creixement de les exportacions?, el MIB italià un 3,11 % i l'IBEX35 un 5,95 %.

En aquest context, l'evolució positiva del fons CaixaBank Bolsa Índice España, FI, durant el segon semestre de 2024, s'explica pel bon comportament de l'índex de referència del fons, l'IBEX 35 Net Return, ja que es tracta d'un fons indexat.

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

En ser un fons indexat a l'IBEX 35 Net Return no prenen decisions d'inversió. L'estratègia del fons continuarà centrada a replicar el comportament de l'índex IBEX-35 Net Return, utilitzant tant accions com futurs, amb una proporció al voltant del 95 %-5 %, respectivament, i implementant els canvis efectuats pel comitè d'experts de l'índex.

#### c) Índex de referència.

IBEX 35 Net Return. L'error de seguiment del fons ha estat del 0,26 %.

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

Durant el període, el patrimoni del fons ha variat segons les classes en un 1,87 % (Estàndard), -2,09 % (Institucional Plus), 7,08 % (Extra), -0,31 % (Platinum) i 2,22 % (Sense Retro) i el nombre de participis en un -1,99 % (Estàndard), 0 % (Institucional Plus), 2,13 % (Extra), -50 % (Platinum) i -13,33 % (Sense Retro). Les despeses directes que ha tingut el fons han estat del 0,5165 %, 0,07 %, 0,3908 %, 0,1444 % i 0,07 % en les classes Estàndard, Institucional Plus, Extra, Platinum i Sense Retro, i les despeses indirectes han estat del 0,00 %, 0,00 %, 0,00 % i 0,00 %, respectivament.

La rendibilitat del fons ha estat del 7,4 %, 7,88 %, 7,54 %, 7,8 %, i 7,88 % per a les classes Estàndard, Institucional Plus, Extra, Platinum i Sense Retro, similar a la de l'índex de referència del 7,68 %.

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

La rendibilitat del fons ha estat superior a la mitjana dels fons amb la mateixa vocació inversora, del 5,79 %.

## 2. INFORMACIÓ SOBRE LES INVERSIONS.

### a) Inversions concretes efectuades durant el període.

L'estratègia del fons ha consistit a intentar replicar l'índex de referència; en aquest cas, l'IBEX-35 Net Return.

Quant a les operacions normals del fons, s'han fet compres i vendes d'accions i futurs de l'IBEX-35, el seu índex de referència, que juntament amb l'evolució de la cartera han donat un resultat positiu per al fons.

Els canvis durant el període es fan per ajustar els valors del fons al seu índex de referència. Durant aquest semestre, amb data 22 de juliol, el comitè d'experts de l'índex va prendre la decisió de donar entrada a PUIG, després de la seva sortida a borsa, substituint la cadena hotelera MELIÀ. En termes de rendibilitat, els actius que més han aportat han estat Iberdrola, IAG, Inditex i Ferrovial amb un +1,44 %, 1,41 %, 1,41 % i 0,57 %, respectivament. Per la banda dels detractors, Repsol, Puig i Rovi han estat els que han tingut un comportament pitjor durant el semestre i han drenat un -0,48 %, -0,25 % i -0,125 %, respectivament.

### b) Operativa de préstec de valors.

N/A

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

El fons ha fet operacions amb instruments derivats complementant les posicions de borsa per gestionar la cartera d'una manera més eficaç. El grau mitjà de palanquejament del període ha estat de l'1,29 %.

### d) Més informació sobre inversions. La remuneració de la liquiditat mantinguda per la IIC ha estat del 3,41 %.

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

N/A

## 4. RISC ASSUMIT PEL FONDS.

La volatilitat d'un 13,19 %, 13,19 %, 13,19 %, 13,19 %, i 13,19 % per a les classes Institucional Plus, Sense Retro, Estàndard, Extra i Platinum ha estat inferior a la del seu índex de referència (13,26 %) i superior a la de la lletra del Tresor a 1 any (0,11 %).

## 5. EXERCICI 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 a través 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 basant-se en l'avaluació del rendiment a mitjà i llarg termini de les companyies en què inverteix i en consonància 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, a través de l'exercici del dret de vot, es pretén influir en les polítiques corporatives per a la millora de les deficiències detectada en matèria ASG.

CaixaBank AM compta amb 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, exercir els drets referents d'acord amb el que conté aquesta declaració.

La informació de detall de les activitats de vot, així com les nostres polítiques de sostenibilitat, es pot trobar a:

[https://www.caixabankassetmanagement.com/page/sostenibilitat\\_am#politicas](https://www.caixabankassetmanagement.com/page/sostenibilitat_am#politicas) <https://vds.issgovernance.com/vds/#/MTEwMDY=>

## 6. INFORMACIÓ I ADVERTIMENTS CNMV.

N/A

## 7. ENTITATS BENEFICIÀRIES DEL FONDS SOLIDARI I IMPORT CREDIT A AQUESTES.

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 FONDS.

En l'assignació d'actius, el panorama per al primer semestre de l'any és atractiu. Malgrat el bon comportament de les borses durant l'any 2024, el creixement econòmic, els beneficis empresarials, la despesa del consumidor i l'entorn de tipus afavoreix un començament d'any atractiu per als actius de risc. Fins i tot així, la política obre nous riscos, per la qual cosa no descartem la necessitat d'un enfocament més tàctic durant les setmanes que venen. El creixement nominal manté el creixement dels beneficis, i, tot i que puguem patir algun

revés en els tipus llargs, la retòrica dels bancs centrals i la caiguda del preu del petroli n'haurien de limitar els danys, mentre que l'ampliació del creixement permet un entorn de diferencials de crèdit i perifèrics favorable.

La política global obre diversos escenaris de «cara o creu» i no resulta possible anticipar-ne el resultat. La presa de possessió de Donald Trump i les diverses alternatives que pugui adoptar marcaran els pròxims mesos. Si veiem la versió més enfocada en política antiimmigratòria i d'aplicació d'aranzels de manera brusca, podrem assistir a una correcció forta de les borses sobre la base d'una preocupació tant pel creixement com per l'efecte sobre els preus. En tot cas, creiem que aquestes forces contràries limitaran la pròpia actuació de polítiques econòmiques molt agressives. També estarem molt atents a les eleccions a Alemanya del febrer, que podrien implicar un canvi basat en una ampliació de déficit fiscal alemany i, per tant, un creixement potencial més gran a Europa; podria ser que la renda variable europea agafés el relleu a l'americana l'any 2025. Tots aquests canvis incidiran en les nostres pròpies polítiques, i la borsa espanyola es mourà en aquest camí.

En ser un fons indexat, no prenem posicions concretes i l'estratègia del fons continuarà centrada a replicar el comportament de l'índex IBEX 35 Net Return, utilitzant tant accions com futurs.

## 10. INFORMACIÓ SOBRE LA POLÍTIKA DE REMUNERACIÓ

### 1) Dades quantitatives:

· Remuneració total abonada per la SGIIC al seu personal desglossada en:

· Remuneració Fixa: 19.194.809 €  
· Remuneració variable: 3.184.433 €

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

· Nombre total d'empleats: 292  
· Nombre de beneficiaris: 251

· Remuneració vinculada a la comissió de gestió variable de la IIC, indicant que no existeix per a les IIC que no apliquin aquest tipus de remuneració.

· No existeix aquest tipus de remuneració

· Remuneració desglossada en:

· Alts càrrecs: indicant el nombre de persones incloses en aquesta categoria i desglossant en remuneració fixa i variable.

o Nombre de persones: 9  
o Remuneració fixa: 1.580.713 €  
o Remuneració variable: 455.457 €

· Empleats l'actuació dels quals tingui una incidència material en el perfil de risc de la IIC (entenen que totes les SGIIC tenen empleats dins aquest grup): indicant el nombre de persones incloses en aquesta categoria i desglossant en remuneració fixa i variable:

o Nombre de persones: 8  
o Remuneració fixa: 1.195.946 €  
o Remuneració variable: 419.251 €

### 2) Contingut qualitatiu:

La política de remuneració de CaixaBank Asset Management, SGIIC, S.A.U. 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 SGIIC i de les IIC que gestiona, així com en els conflictes d'interès potencials, tot això d'acord amb la normativa sectorial aplicable.

CaixaBank Asset Management SGIIC, S.A.U., com a SGIIC i prestadora de serveis d'inversió, requereix 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 Asset Management SGIIC, S.A.U. disposa d'una política de remuneració 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 a nivell individual, de l'àrea o de les IIC gestionades, per tal d'assegurar la seva independència sobre les àrees que supervisen.

Es prohibeix als professionals de CaixaBank AM l'ús d'estratègies personals de cobertura i assegurança de les seves remuneracions o de les obligacions que hi estiguin relacionades, per tal de perjudicar 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 esperonar 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 estarà 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 quantitatius (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.

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