

JPMorgan ETFs (Ireland) ICAV -

Europe Research Enhanced Index Equity (ESG) UCITS ETF

Clase: JPM Europe Research Enhanced Index Equity (ESG) UCITS ETF - EUR (acc)

Descripción general del fondo

ISIN
IE00BF4G7183

Objetivo de Inversión: El Subfondo pretende conseguir una rentabilidad a largo plazo superior a la del índice MSCI Europe (Total Return Net) (el «Índice de referencia») invirtiendo principalmente y de forma activa en una cartera de compañías europeas.

Política de inversión: El Subfondo aplica una estrategia de inversión gestionada activamente.

Enfoque de inversión

- Emplea un proceso de selección de valores ascendente y de carácter fundamental.
- Enfoque de índice mejorado para construir una cartera en función del índice de referencia sobreponderando los títulos que presenten el mayor potencial de revalorización e infraponderando los valores considerados más sobrevalorados.
- Cartera diversificada con una construcción disciplinada que hace hincapié en el control de los riesgos.
- Aplica un filtro basado en el valor y en normas e implementa umbrales de inversión mínimos en empresas con características ESG positivas.

Perfil del Inversor: Typical investors in the Sub-Fund are expected to be investors who want to take broad market exposure to European stock markets, who seek to benefit from potential excess returns with similar risks to investing in securities representing the Benchmark and who are prepared to accept the risks associated with an investment of this type, including the volatility of such market.

Gestor/es de carteras	Divisa de la clase de acción	Lanzamiento de la clase
Piera Elisa Grassi Nicholas Farserotu	EUR	10 Oct 2018
Especialista(s) en inversión	Activos del fondo	Domicilio
Ruairidh Hill	EUR 1433,0m	Irlanda
Divisa de referencia del fondo	Val. liq. EUR	Acciones en circulación
EUR	41,9392	34.996.600
	Lanzamiento del fondo	Gastos corrientes
	10 Oct 2018	0,25%
		Préstamo de valores
		No

Información sobre factores ESG

Enfoque ESG - ESG Promoción

Promueve características sociales y/o medioambientales

Clasificación según el Reglamento sobre la divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros («SFDR»): Artículo 8

Artículo 8: estrategias que promueven características ambientales o sociales pero no tienen como objetivo principal la inversión sostenible.

Rating del Fondo A 30 abril 2024

Categoría de Morningstar™ RV Europa Cap. Grande Blend

Rentabilidad

1 Clase: JPM Europe Research Enhanced Index Equity (ESG) UCITS ETF - EUR (acc)

2 Índice de referencia: MSCI Europe Index (Total Return Net)

EVOLUCIÓN DE 100.000 EUR Años naturales



RENTABILIDAD - AÑO NATURAL (%)

	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023
1	-	-	-	-	-	29,23	-1,79	25,63	-9,40	17,17
2	-	-	-	-	-	26,05	-3,32	25,13	-9,49	15,83

RENTABILIDAD (%)

	ACUMULADA/O				Anualizado		
	1 mes	3 meses	1 año	YTD	3 años	5 años	Lanzamiento
1	-0,27	5,69	12,16	7,47	9,25	8,97	10,06
2	-0,91	5,00	10,98	6,65	8,15	7,80	8,53

INFORMACIÓN SOBRE LA RENTABILIDAD

La rentabilidad histórica no es indicativa de la rentabilidad actual ni futura. El valor de sus inversiones y los ingresos derivados de ellas pueden aumentar y disminuir, por lo que podría no recuperar todo el capital invertido.

ESG

Podrá obtener más información sobre el enfoque de inversión sostenible de J.P. Morgan Asset Management consulte la página web <https://am.jpmorgan.com/es/esg>.

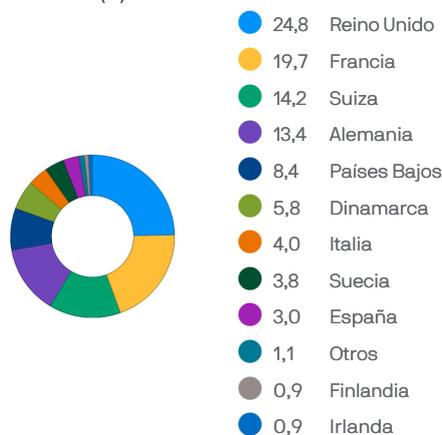
Análisis de la Cartera

	3 años	5 años
Correlación	1,00	1,00
Alfa (%)	1,01	1,09
Beta	1,00	0,99
Volatilidad anualizada (%)	13,46	15,44
Ratio Sharpe	0,67	0,61
Tracking Error (%)	1,16	1,19
Ratio de información	0,88	0,88

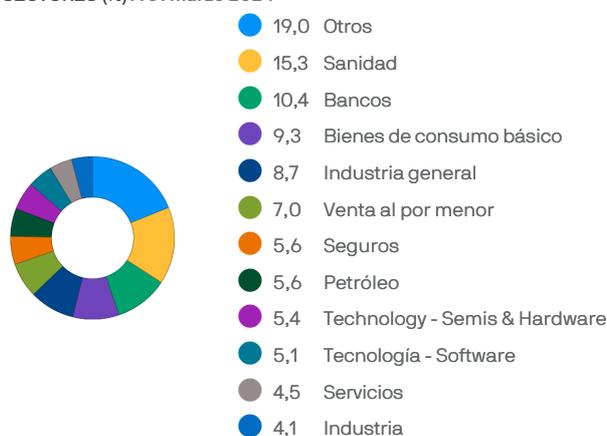
Posiciones A 31 marzo 2024

Princ. 10	Sector	% de activos
Novo Nordisk	Sanidad	4,4
ASML	Technology - Semis & Hardware	4,2
Nestle	Bienes de consumo básico	3,3
Shell	Petróleo	2,8
LVMH	Venta al por menor	2,7
AstraZeneca	Sanidad	2,5
Roche	Sanidad	2,0
Schneider Electric	Industria general	1,9
Allianz	Seguros	1,9
Air Liquide	Química	1,8

REGIONES (%) A 31 marzo 2024



SECTORES (%) A 31 marzo 2024



NÚMERO DE TENENCIAS

142

Información de cotización

Mercado de valores	Ticker de cotización	Moneda de negociación	Ticker Bloomberg	Reuters RIC	SEDOL
London Stock Exchange	JREE	EUR	JREE LN	JREE.L	BFZ4CL6
London Stock Exchange	JERE	GBX	JERE LN	JERE.L	BF2F609
Borsa Italiana	JREE	EUR	JREE IM	JREE.MI	BYXH771
Deutsche Borse	JREE	EUR	JREE GY	JREE.DE	BDR5M35
Six Swiss Exchange	JREE	EUR	JREE SW	JREE.S	BYXH7F9
London Stock Exchange	JERA	USD	JERA LN	JERA.L	BYXH6V8

Riesgos principales

El valor de su inversión puede subir o bajar, y podría recuperar menos de lo que invirtió originalmente.

El valor de un título de renta variable puede subir o bajar dependiendo de la evolución de la empresa correspondiente y de las condiciones generales del mercado, en ocasiones de manera rápida o impredecible. Si una empresa se declara en quiebra o se somete a otro procedimiento de reestructuración financiera similar, sus acciones en circulación suelen perder la mayor parte o la totalidad de su valor.

Puesto que los instrumentos mantenidos por el Subfondo pueden estar denominados en divisas distintas de la Moneda base, el Subfondo podrá verse perjudicado por los reglamentos de control cambiario o las fluctuaciones de los tipos de cambio. Por este motivo, las variaciones de los tipos de cambio pueden repercutir en el valor de la cartera del Subfondo, así como afectar el valor de las Acciones. Debido a la composición del índice de referencia, la cartera del Subfondo puede estar más concentrada geográficamente que en el caso de otros Subfondos con carteras más diversificadas y, por consiguiente, puede estar sujeta a una mayor volatilidad que dichos Subfondos.

La exclusión del universo de inversión del Subfondo de compañías que no cumplan determinados criterios ESG podría hacer que el Subfondo obtenga una rentabilidad diferente en comparación con otros fondos similares que no cuenten con dicha política.

El Subfondo pretende conseguir una rentabilidad superior a la del índice de referencia; no obstante, es posible que el Subfondo obtenga una rentabilidad inferior a la del índice de referencia.

Si desea más información sobre riesgos, consulte el apartado «Información sobre riesgos» del Folleto.

Información general

Antes de invertir, obtenga y consulte el folleto vigente (disponible en inglés), el Documento de datos fundamentales (disponible en español) y cualquier documento de oferta local aplicable. Puede obtener de forma gratuita un ejemplar de estos documentos, así como del informe anual, del informe semestral y de los estatutos sociales, solicitándolo a su asesor financiero, a su contacto regional de J.P. Morgan Asset Management, al emisor del fondo (véase a continuación) o en www.jpmm.es.

Podrá obtener un resumen de los derechos de los inversores en español en am.jpmm.com/es/reg-updates. J.P. Morgan Asset Management podrá adoptar la decisión de rescindir los acuerdos formalizados para la comercialización de sus organismos de inversión corporativo.

Este material no debe considerarse como un asesoramiento o recomendación de inversión. Es probable que las inversiones y la rentabilidad del Fondo hayan cambiado desde la fecha del informe. En la medida en que lo permita la ley aplicable, podremos grabar llamadas telefónicas y hacer un seguimiento de las comunicaciones electrónicas con el fin de cumplir con nuestras obligaciones legales y regulatorias, así como con nuestras políticas internas. Los datos de carácter personal serán recopilados, almacenados y procesados por J.P. Morgan Asset Management de conformidad con nuestra política de privacidad EMEA disponible en www.jpmm.com/emea-privacy-policy.

Si desea obtener información adicional sobre el mercado objetivo del Subfondo, consulte el folleto.

El ETF cotiza en el Sistema Internacional de Cotizaciones (SIC) de la Bolsa Mexicana de Valores (BMV). El registro no supone la certificación de la rentabilidad del ETF.

Indicador de riesgo - El indicador de riesgo se basa en el supuesto de que usted mantendrá el producto 5 año(s). El riesgo del producto puede ser muy superior en caso de que se mantenga durante un periodo inferior al recomendado.

La cifra de gastos corrientes comprende la comisión de gestión anual y los gastos operativos y administrativos. Excluye los costes de transacción y podría diferir de los gastos corrientes según el documento de datos fundamentales (KID), que constituyen una estimación basada en los gastos reales en que se ha incurrido durante el último año.

Información sobre rentabilidad

Fuente: J.P. Morgan Asset Management. La rentabilidad de la clase de participaciones que se indica se basa en el valor liquidativo de la clase de participaciones, supone la reinversión de los ingresos (brutos) e incluye los gastos corrientes efectivos y excluye los gastos

de entrada y salida. La rentabilidad mostrada se basa en el VL, que podría no coincidir con el precio de mercado del ETF. Los accionistas podrían cosechar rentabilidades diferentes a las rentabilidades basadas en el VL.

La rentabilidad de su inversión podría variar como consecuencia de las fluctuaciones cambiarias si su inversión se realiza en una moneda distinta a la empleada en el cálculo de la rentabilidad histórica.

El índice de referencia se utiliza únicamente con fines comparativos, a menos que se indique expresamente lo contrario en el objetivo y la política de inversión del Subfondo.

Los índices no incluyen comisiones o gastos de explotación y no puede invertirse en ellos.

Fuentes de información

La información del fondo, incluidos los cálculos de la rentabilidad y otros datos, la proporciona J.P. Morgan Asset Management (nombre comercial de los negocios de gestión de activos de JPMorgan Chase & Co. y sus filiales en todo el mundo).

Todos los datos se refieren a la fecha del documento salvo que se indique lo contrario.

© 2024 Morningstar. Todos los derechos reservados. La información que figura en este documento: (1) es propiedad de Morningstar; (2) su reproducción o distribución está prohibida; y (3) no se garantiza que sea precisa, íntegra ni oportuna. Ni Morningstar ni sus proveedores de contenidos son responsables de ningún daño o pérdida que se derive de cualquier uso que se haga de esta información.

Fuente del Índice de referencia: MSCI. Ni MSCI ni ningún otro tercero que participe o intervenga en la recopilación, procesamiento o creación de los datos de MSCI realizan manifestaciones ni ofrecen garantías, expresas o implícitas, respecto a dichos datos (o a los resultados que se obtengan del uso de los mismos) y, por la presente, todas dichas partes niegan de forma expresa cualquier manifestación o garantía de originalidad, integridad, comerciabilidad o idoneidad de dichos datos para un fin determinado. Sin perjuicio de lo que antecede, ni MSCI, ni ninguna de sus filiales o terceros que participen o intervengan en la recopilación, procesamiento o creación de los datos, asumirán, en ningún caso, la responsabilidad por cualesquiera daños directos, indirectos, especiales, punitivos, consecuenciales o de cualquier otra índole (entre los que se incluyen el lucro cesante), incluso en caso de notificarse la posibilidad de que se produzcan dichos daños. Cualquier otra distribución o difusión de los datos de MSCI necesitará la previa autorización expresa y por escrito de MSCI.

Contacto regional

JPMorgan Asset Management (Europe) S.à r.l., Paseo de la Castellana, 31, 28046 Madrid.

Registrada en la Comisión Nacional del Mercado de Valores.

Emisor

JPMorgan Asset Management (Europe) S.à r.l., 6, route de Trèves, L-2633 Senningerberg, Luxembourg. Inscrita en el Registro Mercantil de Luxemburgo con el n.º B27900, con capital social de 10.000.000 EUR.

El Subfondo está autorizado en Irlanda y está regulado por el Banco Central de Irlanda.

El fondo JPMorgan ETFs (Ireland) ICAV comercializado en España figura inscrito en el Registro de la Comisión Nacional del Mercado de Valores ("CNMV") con el número 1656. La entidad gestora es JPMorgan Asset Management (Europe) S.à r.l. y el depositario es Brown Brothers Harriman TrusteeServices (Ireland) Limited.

Definiciones

Val. liq. Valor liquidativo de los activos de un fondo menos sus pasivos, por acción.

Correlación mide la intensidad y la dirección de la relación entre cómo se mueve la rentabilidad del fondo y cómo lo hace la del índice de referencia. Una correlación de 1,00 indica que la rentabilidad del fondo y la del índice de referencia exhiben un movimiento sincronizado y en la misma dirección.

Alfa (%) una medida del exceso de rentabilidad generado por un gestor con respecto al índice de referencia. Un alfa de 1,00 indica que un fondo ha superado a su índice de referencia en un 1%.

Beta mide la sensibilidad de un fondo a los movimientos del mercado (representados por el índice de referencia del fondo). Una beta de 1,10 significa que el fondo podría comportarse un 10% mejor que el índice

de referencia en mercados alcistas y un 10% peor en mercados bajistas, suponiendo que el resto de factores se mantienen constantes. Las betas más altas suelen representar inversiones de mayor riesgo.

Volatilidad anualizada (%) mide el grado en el que las rentabilidades varían al alza y a la baja a lo largo de un periodo concreto.

Ratio Sharpe rentabilidad de una inversión ajustándolo a la cantidad de riesgo asumido (en comparación con una inversión sin riesgo). Cuanto mayor es el ratio de Sharpe, mejores son las rentabilidades frente al riesgo asumido.

Tracking Error (%) mide en cuánto se desvía la rentabilidad de un fondo de la del índice de referencia. Cuanto más bajo sea el número, más cerca se habrá mantenido históricamente la rentabilidad del fondo de la de su índice de referencia.

Ratio de información mide si un gestor está superando al índice de referencia o siendo superado por él, y tiene en cuenta el riesgo asumido para alcanzar la rentabilidad. Un gestor que supere al índice de referencia en un 2% anual presentará un RI más alto que otro que haya alcanzado la misma rentabilidad superior pero haya asumido más riesgo.