

# iShares Green Bond Index Fund (IE) Class Institutional Hedged EUR

## NOVIEMBRE 2020 FICHA INFORMATIVA

La rentabilidad, los desgloses de la cartera y la información sobre los activos netos son a: 30/11/20. Todos los demás datos a: 17/12/20.

Antes de invertir, los inversores deben leer el documento KIID y el folleto (prospectus).

### DESCRIPCIÓN GENERAL DEL FONDO

El Fondo trata de obtener rentabilidad de su inversión mediante una combinación de revalorización del capital y rendimientos que refleje la rentabilidad del Bloomberg Barclays MSCI Green Bond Index, el índice de referencia del Fondo (el Índice). El Fondo invierte principalmente en los valores de renta fija (RF) (como bonos) que componen el Índice, cuyos ingresos se utilizan para financiar proyectos con beneficios medioambientales directos. Se pretende que, en el momento de la adquisición, los valores de RF tendrán una calificación de solvencia a largo plazo que cumpla los requisitos de calificación de solvencia del Índice, actualmente al menos de categoría de inversión (es decir, cumplirán un nivel específico de solvencia), otorgada por Moody's, Standard & Poor's o Fitch Ratings, o que la gestora de inversiones considere que tienen una calificación equivalente. Si las calificaciones de solvencia de un valor de RF se revisan a la baja, el Fondo podrá seguir manteniéndolo hasta que resulte factible vender la posición, de forma compatible con los requisitos del Índice o los mejores intereses del Fondo.

### CRECIMIENTO HIPOTÉTICO DE 10.000



La clase de acciones y la rentabilidad del índice de referencia se muestran en EUR. Fuente: BlackRock. La rentabilidad se muestra sobre la base del valor liquidativo (NAV), con reinversión de los ingresos brutos.

### % RENTABILIDAD ANUAL

	2019	2018	2017	2016	2015
Clase del fondo	6.58	-0.81	N/D	N/D	N/D
Índice de referencia	8.40	-1.11	N/D	N/D	N/D

El rendimiento de la clase de acciones es calculado en base al valor liquidativo, neto de comisiones en la moneda de negociación específica y no incluye gastos de venta o impuestos. Los rendimientos suponen la reinversión de cualquier distribución.

### RENTABILIDAD ACUMULADA Y ANUALIZADA

	Acumulativo (%)				Anualizado (% p.a.)			
	1m	3m	6m	YTD	1 Año	3 Años	5 Años	Desde su creación
Clase del fondo	0.53%	1.81%	3.69%	5.01%	4.15%	3.42%	N/D	3.41%
Índice de referencia	0.03%	1.90%	2.28%	3.66%	2.54%	3.45%	N/D	3.51%
Clasificación cuartil	3	1	2	1	2	1	N/D	N/D

Las cifras mostradas hacen referencia a rentabilidades pasadas. La rentabilidad pasada no es un indicador fiable de los resultados futuros y no debe ser el único factor que se considere a la hora de seleccionar un producto o estrategia. La clase de las acciones y la rentabilidad de referencia se muestran en EUR, mientras que la rentabilidad de referencia del fondo de cobertura se muestra en EUR. La rentabilidad mostrada se basa en el valor liquidativo (Net Asset Value, NAV), con reinversión de los rendimientos brutos, cuando proceda. En caso de que su inversión se haya realizado en una divisa que no sea la utilizada en el último cálculo de rentabilidad, la rentabilidad de su inversión podrá ser mayor o menor en función de las fluctuaciones de la divisa. Fuente: BlackRock

**Capital en riesgo.** Todas las inversiones financieras conllevan un cierto riesgo. Por consiguiente, el valor de su inversión y los rendimientos generados por ella variarán, y no puede garantizarse la cantidad de su inversión inicial.

### FACTORES CLAVES

Clase de activos	Renta Fija
Categoría Morningstar	Global Bond - EUR Hedged
Fecha de lanzamiento del fondo	16/03/17
Fecha de lanzamiento de la clase del fondo	16/03/17
Divisa base del Fondo	EUR
Divisa de la clase del fondo	EUR
Tamaño total del fondo (millones)	2,363.50 EUR
Índice de referencia	BBG Barc Global Green Bond Index
Domicilio	Irlanda
Tipo de fondo	UCITS
ISIN	IE00BD0DT792
Ticker Bloomberg	BLGBIEA
Tipo de distribución	Acumulativo
Inversión Inicial Mínima	500,000

### POSICIONES PRINCIPALES (%)

FRANCE (REPUBLIC OF) 1.75 06/25/2039	7.58
BELGIUM (KINGDOM OF) 1.25 04/22/2033	2.22
NETHERLANDS (KINGDOM OF) 0.5 01/15/2040	2.16
IRELAND (REPUBLIC OF) 1.35 03/18/2031	1.50
GERMANY (FEDERAL REPUBLIC OF) 0 08/15/2030	1.37
KFW MTN RegS 0 09/15/2028	1.27
GERMANY (FEDERAL REPUBLIC OF) 0 10/10/2025	1.00
KFW MTN RegS 0.01 05/05/2027	0.88
SOCIETE DU GRAND PARIS MTN RegS 1 02/18/2070	0.77
SOCIETE DU GRAND PARIS MTN RegS 1.7 05/25/2050	0.70
<b>Total de la cartera</b>	<b>19.45</b>

Tenencias sujetas a cambio

### CALIFICACIONES



**Riesgos claves:** El Fondo tiene por objetivo obtener la rentabilidad total de su inversión, a través de una combinación de revalorización del capital y rendimientos, que refleje la rentabilidad del Índice Citigroup Eurodollar Bond, el índice de referencia del Fondo.

## DESGLOSE POR SECTORES (%)

	Fondo	Índice de referencia	+/-
Agencias	23.36	23.69	-0.33
Financiero	17.91	18.03	-0.12
Government	16.16	15.96	0.20
Utilities	13.12	13.17	-0.06
Supranacional	10.31	10.68	-0.37
Autoridades locales	7.76	8.05	-0.29
Cubierto	3.60	4.02	-0.42
Industria	3.26	3.21	0.05
Soberano	2.97	3.08	-0.12
Liquidez	1.54	0.00	1.54
Hipotecas Comerciales Respaldadas por Activos	0.01	0.10	-0.08

Pueden producirse ponderaciones negativas como resultado de circunstancias específicas (incluidas diferencias horarias entre la fecha de negociación y de liquidación de los valores comprados por los fondos) y/o el uso de ciertos instrumentos financieros, entre ellos los derivados, que se pueden utilizar para ampliar o reducir la exposición al mercado y/o la gestión del riesgo. Las asignaciones están sujetas a cambios.

## CARACTERÍSTICAS DE LA CARTERA

Duración Efectiva (años)	8.24
Duración Modificada	8.28
Rendimiento a peor (%)	0.32
Desviación Típica	4.18
Vencimiento Promedio Ponderado	0.34%

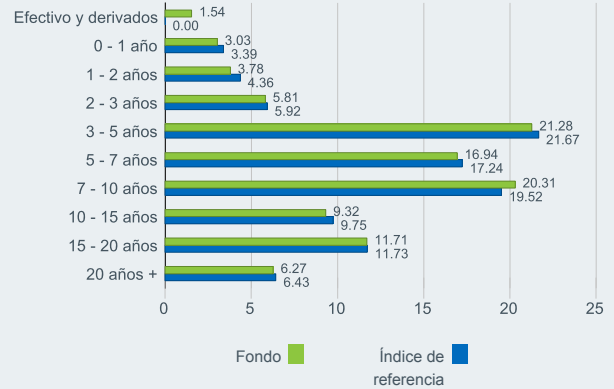
## COMISIONES Y GASTOS

Máx Comisión inicial	0.00%
Máx Comisión de salida	0.00%
Gasto corriente	0.23%
Comisión de rendimiento	0.00%

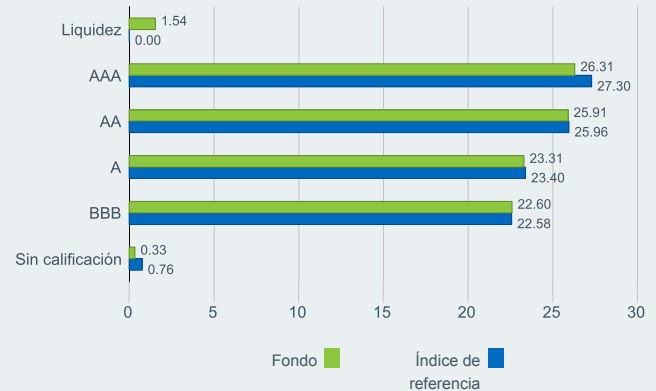
## INFORMACIÓN DE OPERACIONES

Liquidación	Fecha de la operación + 3 días
Frecuencia de negociación	Liquidez diaria

## DESGLOSE POR VENCIMIENTO (%)



## CALIDAD DE CRÉDITO (%)



### INFORMACIÓN IMPORTANTE:

La información contenida en el presente documento no constituye asesoría de inversión ni una oferta, invitación, recomendación o solicitud alguna de realizar operaciones con productos financieros ni debe constituir la base para la toma de decisiones de inversión. Algunos fondos gestionados por BlackRock han sido registrados para su distribución en España. En España, los fondos BlackRock Index Selection Funds (ISF) están registrados en la Comisión Nacional del Mercado de Valores (CNMV) con el número 1504, los fondos BlackRock Fixed Income Dublin Funds (FIDF) están registrados en la CNMV con el número 1505, y los fondos BlackRock Global Index Funds (BGIF) están registrados con el número 1239. PRODUCTOS DE INVERSIÓN: NO ESTÁN ASEGURADOS POR LA FDIC • SIN GARANTÍA BANCARIA • PUEDEN PERDER VALOR. Los folletos con las especificaciones para cada fondo registrado han sido también registrados en la CNMV. Ninguna autoridad de regulación de valores ha confirmado la exactitud de ninguna información aquí expuesta. Este documento contiene productos y servicios de BlackRock, Inc. que podrían ser ofertados directamente o indirectamente en el Principado de Andorra, y no debe ser tratada o considerada como una inducción a la contratación en ninguna jurisdicción, incluyendo el Principado de Andorra.

## GLOSARIO

**Capitalización del mercado:** es el valor total de las acciones emitidas por una compañía que cotiza en el mercado bursátil.

**Gastos corrientes:** es una cifra que representa todos los gastos anuales y otros pagos que se retiran del fondo.

**Clasificación cuartil:** categoriza un fondo en cuatro bandas iguales basándose en su rentabilidad durante un período especificado dentro del sector relevante de Morningstar. El cuartil principal o superior contiene el 25 % principal de los fondos y llega hasta el 4° o cuartil inferior que contiene el 25 % inferior de los fondos.

**Comisión de rendimiento:** se cobra sobre cualquier rendimiento que, sujeto a su cuota máxima, alcance el fondo por encima del rendimiento de la comisión de su índice de referencia. Consulte el folleto para obtener información más detallada.

## CARACTERÍSTICAS DE SOSTENIBILIDAD

Las Características de Sostenibilidad pueden ayudar a los inversores a integrar aspectos de sostenibilidad, de carácter no financiero, en su proceso de inversión. Estos parámetros permiten a los inversores evaluar los fondos en función de los riesgos y oportunidades derivados de su valoración medioambiental, social y de gobierno corporativo (ESG). Este análisis puede proporcionar información valiosa acerca de la gestión eficaz y las perspectivas financieras a largo plazo de un fondo.

Los siguientes parámetros se ofrecen únicamente a efectos de transparencia e información. La existencia de una clasificación ESG no supone una indicación de cómo o de si los factores ESG se integrarán en un fondo. Los parámetros se basan en las Calificaciones de Fondos ESG de MSCI y, a menos que se indique lo contrario en la documentación de un fondo y aparezcan incluidos dentro del objetivo de inversión de un fondo, no cambian el objetivo de inversión de un fondo ni limitan el universo de inversión del fondo, y no existe ninguna indicación de que un fondo vaya a adoptar una estrategia de inversión basada en los criterios ESG o de Impacto, u otros filtros de exclusión. Para obtener más información acerca de la estrategia de inversión de un fondo, lea el folleto del fondo.

Calificación de Fondos ESG de MSCI (AAA-CCC)	A	Puntuación de Calidad ESG de MSCI (0-10)	6.70
Puntuación de Calidad ESG de MSCI - Percentil entre Empresas Similares	78.36%	Porcentaje de Cobertura ESG de MSCI	96.68%
Clasificación Global de Fondos de Lipper	Bond Global EUR	Intensidad Media Ponderada de Exposición al Carbono de MSCI (toneladas de emisiones de CO <sub>2</sub> / millón de \$ en ventas)	430.85
Fondos en Grupo de Características Similares	573		

Todos los datos proceden de las Calificaciones de Fondos ESG de MSCI a fecha de **01-Dec-2020**, tomando como base las tenencias a fecha de **30-Jun-2020**. Por lo tanto, las características de sostenibilidad de los fondos pueden diferir de las Calificaciones de Fondos ESG de MSCI en algún momento determinado.

Para estar incluido en las Calificaciones de Fondos ESG de MSCI, el 65 % de la ponderación bruta del fondo debe proceder de valores cubiertos por MSCI ESG Research (algunas posiciones en efectivo y otros tipos de activos que no se consideran relevantes para el análisis ESG realizado por MSCI se eliminan antes de calcular la ponderación bruta de un fondo; los valores absolutos de las posiciones cortas se incluyen, pero se tratan como no cubiertos), la fecha de las tenencias del fondo debe ser inferior a un año y el fondo debe contar, como mínimo, con diez valores. Para los fondos de reciente creación, las características de sostenibilidad suelen estar disponibles seis meses después de su lanzamiento.

**Los parámetros se basan en datos de MSCI para mantener su consistencia con la calificación de los fondos de MSCI; este fondo se gestiona utilizando datos de Sustainalytics.**

## GLOSARIO DE ESG:

**Calificación de Fondos ESG de MSCI (AAA-CCC):** La Clasificación ESG de MSCI se calcula como una asignación directa de las Puntuaciones de Calidad ESG a categorías de calificación basadas en letras (por ejemplo, AAA = 8,6-10). Las Clasificaciones ESG van de líder (AAA y AA), media (A, BBB y BB) hasta rezagada (B y CCC).

**Puntuación de Calidad ESG de MSCI - Percentil entre Empresas Similares:** El Percentil ESG del fondo en comparación con su grupo de características similares de Lipper.

**Clasificación Global de Fondos de Lipper:** El grupo de características similares del grupo se define de acuerdo con lo establecido en la Clasificación Global de Lipper.

**Fondos en Grupo de Características Similares:** El número de fondos del grupo de características similares relevante de la Clasificación Global de Lipper que también tienen cobertura ESG.

**Puntuación de Calidad ESG de MSCI (0-10):** La Puntuación de Calidad ESG de MSCI (0-10) de los fondos se calcula utilizando la media ponderada de las puntuaciones ESG de las tenencias del fondo. La Puntuación también tiene en cuenta la tendencia de Clasificación ESG de las tenencias y la exposición del fondo a valores de la categoría rezagada. MSCI ofrece una calificación para los valores subyacentes en función de su exposición a 35 riesgos ESG específicos del sector y su capacidad para gestionar estos riesgos en comparación con empresas del mismo sector.

**Porcentaje de Cobertura ESG de MSCI:** El porcentaje de las tenencias de un fondo que tienen datos de clasificación ESG de MSCI.

**Intensidad Media Ponderada de Exposición al Carbono de MSCI (toneladas de emisiones de CO<sub>2</sub> / millón de \$ en ventas):** Mide la exposición de un fondo a las empresa con emisiones intensivas de carbono. Esta cifra representa las emisiones estimadas de gases de efecto invernadero por cada millón de \$ en ventas en las tenencias del fondo. Esto permite realizar una comparación entre fondos de diferentes tamaños.

## INFORMACIÓN IMPORTANTE:

Parte de la información incluida en el presente documento (la «Información») ha sido suministrada por MSCI ESG Research LLC, un asesor de inversiones regulado en virtud de lo establecido en la Ley de Asesores de Inversión de 1940, y puede incluir datos de sus filiales (incluida MSCI Inc. y sus filiales [«MSCI»]), o de terceros (cada uno de ellos, un «Proveedor de Información»), y no podrá ser reproducida ni divulgada de forma total ni parcial sin la obtención de un permiso previo y por escrito. La Información no se ha remitido para su aprobación, ni se ha recibido dicha aprobación, por parte de la SEC de los EE. UU. ni de ningún otro organismo regulador. La Información no se puede utilizar para crear obras derivadas, ni en relación con, ni como parte de, una oferta de compra o venta, o una promoción o recomendación de cualquier valor, instrumento o producto financiero, o estrategia de negociación, ni se debe considerar como una indicación o garantía de ningún rendimiento futuro, análisis, previsión o predicción. Algunos fondos pueden basarse o estar vinculados a índices de MSCI, y MSCI puede recibir una compensación basadas en los activos gestionados del fondo o en función de otros factores. MSCI ha establecido una barrera de información entre la investigación de los índices de renta variable y determinada Información. Ninguna parte de la Información se podrá utilizar para determinar qué valores se deben comprar o vender, ni cuándo comprarlos o venderlos. La Información se ofrece «tal cual» y el usuario de la Información asume la totalidad del riesgo derivado cualquier uso que pueda realizar o permitir realizar en relación con la Información. Ni MSCI ESG Research ni ninguna Parte relacionada con la Información ofrece ninguna representación o garantía, expresa o implícita (rechazadas de forma expresa), ni incurrirá en ningún tipo de responsabilidad por cualquier error u omisión presentes en la Información, ni en relación con cualquier daño que se pueda asociar con esta. Todo lo expuesto anteriormente no excluirá ni limitará ninguna responsabilidad que no pueda excluirse o limitarse en virtud de la legislación aplicable.