

Datos fundamentales para el inversor

El presente documento recoge los datos fundamentales sobre este Fondo que el inversor debe conocer. No se trata de material de promoción comercial. La ley exige que se le facilite esta información para ayudarle a comprender la naturaleza del Fondo y los riesgos que comporta invertir en él. Es aconsejable que lea el documento para poder tomar una decisión fundada sobre la conveniencia o no de invertir en él.



ABN·AMRO Investment Solutions

Parnassus US Sustainable Equities

un subfondo de ABN AMRO Funds

A EUR Capitalisation (ISIN LU1481505755)

Este Subfondo está gestionado por ABN AMRO Investment Solutions, una sociedad de gestión de inversiones del Grupo ABN Amro.

Objetivos y política de inversión

Parnassus US Sustainable Equities pertenece a la categoría de fondos de gestor único.

El Fondo pretende incrementar el valor de sus activos a largo plazo invirtiendo sobre todo en títulos mobiliarios de renta variable, como participaciones, otras participaciones en capital tales como participaciones de cooperativas y certificados de participación emitidos por, o bien warrants sobre títulos mobiliarios de renta variable de, sociedades domiciliadas en Norteamérica o que ejercen la mayor parte de su actividad económica en dicha región.

La selección de las inversiones se basará en una combinación de criterios financieros, así como medioambientales, sociales y de gobierno corporativo. El Fondo promueve aspectos medioambientales y sociales y reúne los requisitos para ser un producto de inversión de conformidad con el artículo 8(1) del Reglamento (UE) 2019/2088 sobre la divulgación de información relacionada con la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros. A este respecto, el gestor del Fondo ha establecido un proceso que integra la investigación fundamental y ESG (medioambiental, social y de gobierno corporativo) para evaluar la calidad empresarial y la valoración de las empresas potenciales. Las evaluaciones ESG incluyen tanto filtrados de exclusión como una valoración ESG ascendente.

Tras la implementación de los filtros de sostenibilidad (exclusiones y puntuación ESG), el cuartil inferior de empresas queda excluido del universo susceptible de inversión. Así, la puntuación ESG de la cartera es mejor que la del universo susceptible de inversión. El análisis de sostenibilidad cubre el 100% de los valores de la cartera (el efectivo y los depósitos no están cubiertos por el análisis ESG).

Como parte de la Política de Inversión Sostenible de la Sociedad Gestora, el Fondo cumple con los conjuntos de exclusiones que se aplican al producto de inversión del artículo 8. Además, el Fondo excluye las empresas que participan (por encima del umbral del 10% de los ingresos) I) en la extracción, explotación, producción y/o refinado de combustibles fósiles definidos por el gestor de la cartera como petróleo y gas (excepción: empresas que utilizan energía de origen fósil para su funcionamiento u otras), II) en la energía nuclear, III) en la

fabricación de alcohol.

Las limitaciones metodológicas pueden evaluarse en términos de: naturaleza de la información ESG (cuantificación de los datos cualitativos), cobertura ESG (algunos datos no están disponibles para determinados emisores) y homogeneidad de los datos ESG (diferencias metodológicas).

La asignación mínima de activos en dichos valores sobre una base consolidada (inversiones directas e indirectas) será del 60% del activo neto del Fondo (tras la deducción del efectivo del Fondo).

Además, la inversión mínima del fondo en valores de renta variable será del 75% de sus activos netos.

Las inversiones en títulos de deuda no superarán el 15% de su patrimonio neto.

El fondo puede invertir como máximo el 10% de sus activos netos en fondos seleccionados de acuerdo con una serie de criterios cualitativos y cuantitativos.

El fondo puede invertir hasta el 10% de sus activos netos en instrumentos derivados para la inversión, la gestión eficiente de la cartera o con fines de cobertura.

Este Fondo se gestiona activamente y se compara con MSCI USA TR Net a efectos de indicadores de rendimiento y nivel de riesgo. Sin embargo, la referencia a este índice no constituye ningún objetivo o limitación en la gestión y composición de la cartera y el Fondo no restringe su universo a los componentes del índice. El índice no evalúa ni incluye a sus componentes en función de las características medioambientales y/o sociales y, por lo tanto, no está alineado con las características ESG que promueve el Fondo.

Por tanto, las rentabilidades pueden diferir materialmente del rendimiento del índice de referencia.

La divisa base del Fondo es el USD.

El periodo mínimo de tenencia recomendado es de 5 años.

Los ingresos se reinvierten sistemáticamente.

Los inversores pueden solicitar el reembolso de sus participaciones a diario (en los días hábiles de los bancos de Luxemburgo).

Perfil de riesgo y remuneración

Menor riesgo

Mayor riesgo

Potencialmente menor remuneración

menor

Potencialmente mayor remuneración

1

2

3

4

5

6

7

El perfil de riesgo y rentabilidad del Fondo se basa en las variaciones de valor que ha registrado una inversión en este Fondo. La clasificación del Fondo es un reflejo razonablemente exacto del riesgo del Fondo en las condiciones pasadas del mercado. Los datos históricos empleados para determinar el perfil no son una indicación fiable del riesgo inherente en circunstancias y eventos futuros que difieran de los que han existido en el pasado para el Fondo.

El perfil de riesgo y rentabilidad de un Fondo es un indicador, pero no un objetivo ni una garantía y puede variar en el transcurso del tiempo.

La categoría más baja de riesgo no significa que el Fondo esté libre de riesgo. Una rentabilidad posiblemente más alta generalmente implica también riesgos posiblemente más altos.

¿Por qué el Fondo pertenece a esta categoría específica?

Las inversiones en renta variable incluyen importantes fluctuaciones de los precios debido, por ejemplo, a información negativa acerca del emisor o del mercado. Además, estas fluctuaciones frecuentemente se amplifican a corto plazo.

El nivel de riesgo del Fondo refleja principalmente los riesgos de mercado derivados de inversiones en renta variable internacional.

Abajo se describen otros riesgos materialmente relevantes para el Fondo que no han sido captados adecuadamente por el indicador:

Riesgo de contraparte: Este riesgo está asociado con la capacidad de una contraparte en una transacción financiera de cumplir sus compromisos, como pago, entrega y reembolso.

Riesgo Operativo y de Custodia: Algunos mercados están menos regulados que la mayoría de mercados internacionales; por tanto, los servicios relacionados con la custodia y liquidación del Fondo en esos mercados podría conllevar más riesgos.

Riesgo de crédito: Este riesgo está relacionado con la capacidad de un emisor de cumplir sus compromisos; las rebajas en la calificación de

una emisión o un emisor pueden dar lugar a una disminución del valor de los bonos en que ha invertido el fondo.

Si desea más información sobre riesgos, consulte la sección de «Riesgos de Inversión» del folleto del Fondo, que puede obtenerse en www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Gastos

Los gastos que soporta el inversor se destinan a sufragar los costes de funcionamiento del Fondo, incluidos los gastos de comercialización y distribución. Dichos gastos reducen el potencial de crecimiento de su inversión.

Gastos no recurrentes percibidos con anterioridad o con posterioridad a la inversión	
Comisión de entrada	5,00%
Comisión de salida	1,00%
<i>Este es el máximo que puede detrarse de su capital antes de proceder a la inversión y antes de abonar el producto de la inversión.</i>	
Gastos detraídos del fondo a lo largo de un año	
Gastos corrientes	1,69%
Gastos detraídos del fondo en determinadas condiciones específicas	
Comisión de rentabilidad	ninguna

Los gastos de entrada y salida mostrados representan máximos. En algunos casos el inversor podría pagar menos; consúltelo con su asesor financiero.

El porcentaje de gastos corrientes indicado aquí se basa en los gastos correspondientes al periodo de doce meses finalizado el 31 de diciembre de 2021. Este importe puede variar de un año a otro. No incluye:

- Comisiones de rentabilidad
 - Costes de transacción de la cartera, salvo en el caso de los gastos de entrada o salida soportados por el Fondo con ocasión de la compra o la venta de participaciones de otro organismo de inversión colectiva
- En caso de canje de acciones, se puede cargar a los inversores una comisión máxima del 1,00%.

Si desea más información sobre gastos, consulte la sección de «Comisiones y Costes» (Fees and Costs) del folleto del Fondo, el cual puede obtenerse en www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Rentabilidad histórica



La rentabilidad histórica no es un indicador fiable de los resultados futuros.

En el rendimiento histórico mostrado aquí se tienen en cuenta todos los gastos y costes. Los gastos de entrada/salida se han excluido del cálculo de la rentabilidad histórica.

Esta clase de acciones se lanzó el enero de 2017.

La rentabilidad histórica se ha calculado en EUR y se expresa como cambio porcentual del valor liquidativo del Fondo al final de cada año.

Información práctica

Sociedad gestora

ABN AMRO Investment Solutions, una sociedad de gestión de inversiones del Grupo ABN Amro.

Banco Custodio

State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch.

Información Adicional

Puede solicitar gratuitamente más información sobre el Fondo, ejemplares del folleto y los últimos informes anuales y semestrales en idioma inglés a la Compañía Gestora, a los agentes locales u online en www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Política de remuneración

Puede obtenerse información pormenorizada de la política remunerativa actualizada de la sociedad de gestión, incluidas, entre otras cosas, una descripción de la forma en que se calculan la remuneración y los beneficios, en el siguiente sitio web, una vez se reciba la autorización de la AMF: <https://www.abnamroinvestmentsolutions.com/en/footer/Regulatory-information.html>. Asimismo, puede solicitarse una copia gratuita en papel en el domicilio social de la Sociedad.

Publicación de Precios

Los últimos precios de las acciones del Fondo están disponibles en www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Canje de Acciones

Los accionistas pueden solicitar el canje de una parte o de la totalidad de sus acciones por acciones de otro Fondo, categoría o clase. Para más información sobre la forma de canjear acciones y las reglas aplicables, los accionistas deben consultar el folleto (sección sobre «Suscripción, Canje y Reembolso de Acciones»).

Información específica del fondo

Este documento de datos fundamentales para el inversor describe una clase de participaciones de un subfondo de la SICAV de AAF, mientras que el folleto y los informes anual y semestral más recientes se elaboran con respecto a la SICAV de AAF en su conjunto. Los activos y los pasivos de cada subfondo de la estructura paraguas de AAF están segregados por ley, por lo que solo el beneficio o la pérdida del subfondo incide en su inversión.

Puede haber disponibles más clases de participaciones de este fondo. Para obtener más información, los inversores deben consultar el folleto. Para obtener más información sobre las clases de participaciones que se distribuyen al público en la jurisdicción del inversor, los inversores deben dirigirse a www.abnamroinvestmentsolutions.com.

Legislación Fiscal

El Fondo está sujeto a la legislación y la normativa fiscal de Luxemburgo. En función del país de residencia del accionista, el Estado en el que está establecido el Fondo puede influir sobre la posición fiscal personal del accionista. Para obtener más información, el accionista debe consultar a un asesor fiscal.

Responsabilidad

ABN AMRO Investment Solutions, una sociedad de gestión de inversiones del Grupo ABN Amro únicamente incurrirá en responsabilidad por las declaraciones contenidas en este documento que resulten engañosas, inexactas o incoherentes frente a las correspondientes partes del folleto del Fondo.