AMUNDI EURO LIQUIDITY SHORT TERM RESPONSIBLE - E

INFORMES

Comunicación Publicitaria

30/09/2026

MONETARIO A CORTO PLAZO ■ Artículo 8 ■

Datos clave (Fuente : Amundi)

Valor liquidativo : **10 845,4947 (EUR)**
Fecha de valor liquidativo y activo gestionado : **30/09/2026**
Activos : **22 096,66 (millones EUR)**
Código ISIN : **FR0011176635**
Índice de referencia : **100% ESTR CAPITALISE (OIS)**
Elegibilidad : **Cuenta de valores, seguro de vida**
Money Market NAV Type : **Valor liquidativo variable**

Fondo sin garantía de capital

Objetivo de inversión

El objetivo es conseguir una rentabilidad superior al €STR capitalizado, índice representativo del tipo monetario de la zona euro, una vez considerados los gastos corrientes,siempreincorporando los criterios ESG en el proceso de selección y análisis de los títulos del fondo. Sin embargo, en determinadas situaciones de mercado, como el bajo nivel del €STR, el valor liquidativo de su fondo podrá disminuir de manera estructural y perjudicar al rendimiento de su fondo, lo que podría comprometer el objetivo de conservación del capital de su fondo.
El fondo aplica una gestión con un filtro ISR (Inversión socialmente responsable) que integra criterios extrafinancieros ESG (medioambientales, sociales y de gobierno) en el análisis y la selección de los títulos como complemento a los criterios financieros (liquidez, vencimiento, rentabilidad y calidad).

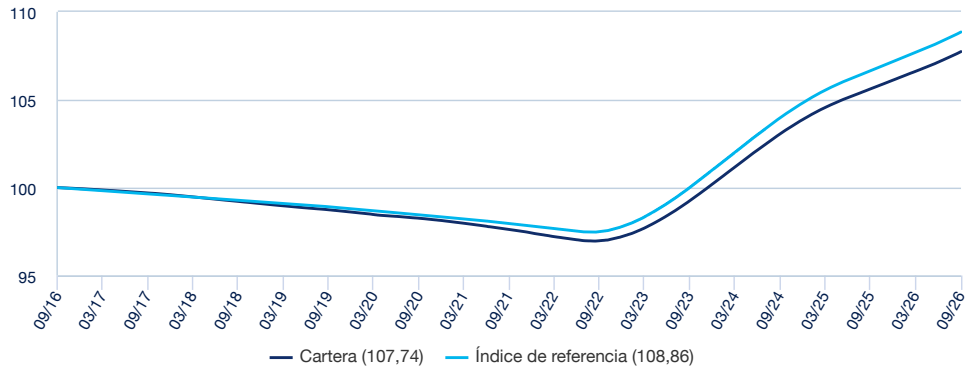
Características principales (Fuente : Amundi)

Forma jurídica : **Fondo de Inversión**
Fecha de creación : **20/01/2012**
Elegibilidad : **Cuenta de valores, seguro de vida**
Asignación de los resultados : **Participaciones de Capitalización**
Mínimo de la primera suscripción : **1 Participación(es)**
Hora límite de recepción de órdenes : **Órdenes recibidas cada día D antes 14:30**
Comisiones de gestión y otros costes administrativos o de funcionamiento : **0,20%**
Periodo mínimo de inversión recomendado : **Entre 1 Dia Y 1 Mese**

Para obtener más información sobre costes, cargos y otros gastos, consulte el Folleto y el PRIIPS KID

Rentabilidades (Fuente: Fund Admin) - El rendimiento pasado no garantiza los resultados futuros

Evolución de la rentabilidad (base 100) * (Fuente: Fund Admin)



Indicador de Riesgo *(Fuente: Fund Admin)*

1 2 3 4 5 6 7

Riesgo más bajo — Riesgo más alto

El indicador de riesgo presupone que usted mantendrá el producto durante Entre 1 Dia Y 1 Mese.
El indicador resumido de riesgo es una guía del nivel de riesgo de este producto en comparación con otros productos. Muestra las probabilidades de que el producto pierda dinero debido a la evolución de los mercados o porque no podamos pagarle.

Indicadores de Riesgo (Fuente : Fund Admin)

	1 año	3 años	5 años	10 Años
Volatilidad de la cartera	0,02%	0,12%	0,21%	0,23%
Volatilidad del índice	0,02%	0,12%	0,21%	0,23%
Tracking Error	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%

** La volatilidad es un indicador estadístico que mide la amplitud de las variaciones de un activo respecto a su media. Ejemplo: unas variaciones diarias de +/- 1,5% en los mercados corresponden a una volatilidad anual del 25%.*

Rentabilidades * (Fuente: Fund Admin)

Desde el	Desde el 30/12/2025	1 mes 31/08/2026	3 meses 30/06/2026	1 Año 30/09/2025	3 años 28/09/2023	3 años 30/09/2021	10 Años 30/09/2016	Desde el 20/01/2012
Cartera	2,00%	2,27%	2,19%	2,00%	2,77%	1,99%	0,75%	0,55%
Índice	2,06%	2,31%	2,23%	2,06%	2,86%	2,13%	0,85%	0,58%
Diferencia	-0,06%	-0,04%	-0,04%	-0,06%	-0,09%	-0,14%	-0,10%	-0,03%

Rentabilidades anuales * (Fuente: Fund Admin)

	2025	2024	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016
Cartera	2,16%	3,66%	3,06%	-0,21%	-0,73%	-0,49%	-0,48%	-0,51%	-0,34%	-0,20%
Índice	2,24%	3,77%	3,29%	-0,03%	-0,53%	-0,47%	-0,40%	-0,37%	-0,36%	-0,32%
Diferencia	-0,08%	-0,11%	-0,22%	-0,18%	-0,19%	-0,02%	-0,09%	-0,14%	0,01%	0,13%

* Fuente : Fund Admin. Las rentabilidades siguientes cubren períodos completos de 12 meses para cada año natural. El valor de las inversiones puede variar al alza o a la baja en función de la evolución de los mercados. Resultados anualizados sobre base de 360 días sobre un período < 1 año y 365 días sobre un período > 1 año (expresadas al redondeo superior)

Indicadores (Fuente : Amundi)

	Cartera
Sensibilidad *	0,00
Nota média	AA-
Número de líneas en cartera	412
Total emisores	76

** La sensibilidad (en puntos) representa el cambio porcentual del precio para una evolución del 1% del tipo de referencia*

La decisión del inversor de invertir en el fondo en cuestión debe tener en cuenta todas las características u objetivos del fondo. No existe ninguna garantía de que las consideraciones ESG mejoren la estrategia de inversión ni la rentabilidad de un fondo.

AMUNDI EURO LIQUIDITY SHORT TERM RESPONSIBLE - E

INFORMES
Comunicación Publicitaria
30/09/2026

MONETARIO A CORTO PLAZO



Patrick Simeon
Responsable de la gestión Monetaria



Benoit Palliez
Gestor de cartera

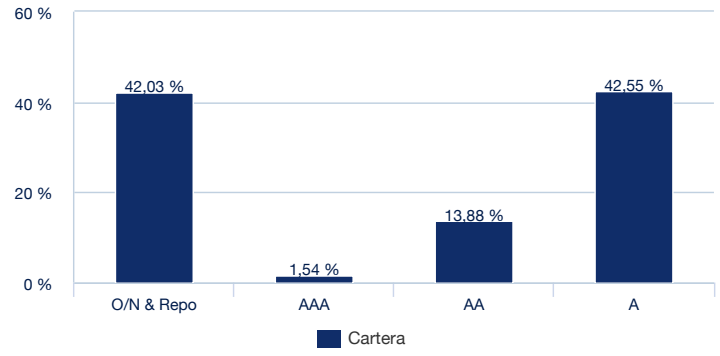
Comentario de gestión

Política monetaria:
El BCE anunció el aumento de sus tipos directores en 25 puntos básicos, llevando así sus tipos de depósito, de refinanciación y de facilidad de préstamo a 2,50%, 2,65% y 2,90% respectivamente.
El BCE justifica este nuevo incremento por presiones inflacionarias aún elevadas, en un contexto de tensiones persistentes en Oriente Medio, y estima que la inflación debería permanecer claramente por encima del objetivo durante un período prolongado.
Las últimas proyecciones muestran una inflación esperada del 3,0% en 2026, 2,5% en 2027 y 2,1% en 2028, mientras que las proyecciones de crecimiento de la zona euro se sitúan ahora en 0,9% en 2026, 1,4% en 2027 y 1,5% en 2028.

Política de gestión:
• Liquidez:
La liquidez instantánea se aseguró principalmente mediante operaciones a un día.
• Riesgo de tipo de interés:
La madurez media ponderada (MMP) de la cartera se sitúa en 3 días al final del período.
• Riesgo de crédito:
Los spreads a corto plazo se mantuvieron estables al final del período; se sitúan en los vencimientos de 3 meses a 1 año en niveles respectivos de €str + 15 a €str + 33 pbs
• Duración media y rating medio:
La duración media ponderada (DVMP) de esta cartera perteneciente a la categoría «monetaria» es de 65 días.
El rating a largo plazo medio de la cartera se mantiene en un buen nivel de AA-.
La cartera cuenta con la mejor calificación otorgada a un fondo monetario por Fitch: AAA-mmf.
• Dimensión socialmente responsable:
La cartera presenta una nota media ISR de C (1.228) al final del mes, es decir, un nivel superior al de su universo de inversión excluyendo el 30% de los emisores peor calificados C (1.137).

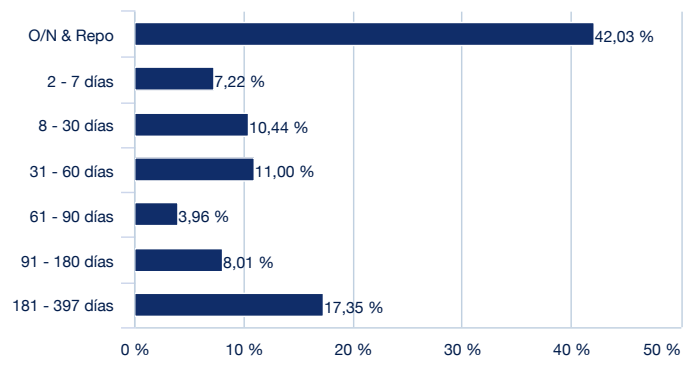
Composición de la cartera (Fuente : Amundi)

Distribucion de la cartera - Calificacion A Largo Plazo (Fuente : Amundi) *



** Notación Mediana calculada por las tres agencias: Fitch, Moody's y Standard & Poor's*

Desglose de la cartera por vencimiento (Fuente : Amundi) *



** O/N & Repo: liquidez colocada día a día*

Principales líneas en cartera (Fuente : Amundi)

	Cartera	Vencimiento	País	Grupo de instrumentos	Contrapartida *
CREDIT AGRICOLE SA	3,01%	07/10/2026	Francia	Monetario	-
FRANCE	2,60%	01/10/2026	Francia	Repo	COMMERZBANK AKTIENGESELLSCHAFT
FRANCE	2,07%	01/10/2026	Francia	Repo	COMMERZBANK AKTIENGESELLSCHAFT
FRANCE	1,93%	01/10/2026	Francia	Repo	BNP PARIBAS
FRANCE	1,91%	01/10/2026	Francia	Repo	COMMERZBANK AKTIENGESELLSCHAFT
FRANCE	1,83%	01/10/2026	Francia	Repo	BNP PARIBAS
FRANCE	1,65%	01/10/2026	Francia	Repo	BNP PARIBAS
ACOSS(AGCE CTL ORGAN SECU SOC)	1,35%	10/11/2026	Francia	Monetario	-
CLEARSTREAM EUROPE AG	1,16%	01/10/2026	Alemania	Repo	LA BANQUE POSTALE
FRANCE	1,01%	01/10/2026	Francia	Repo	LA BANQUE POSTALE

** Para los Repos la madurez indicada es de 1 día. Corresponde al tiempo necesario para liquidar la operación*
** Columna de contrapartida: información únicamente disponible para los Repo*

Amundi Asset Management, SAS (French : Société par Actions Simplifiée) con un capital de 1 143 615 555 €
Sociedad gestora de carteras autorizada por la AMF N° GP 04000036
Sede social: 91-93, boulevard Pasteur – 75015 París – Francia 437 574 452 RCS París

AMUNDI EURO LIQUIDITY SHORT TERM RESPONSIBLE - E

INFORMES

Comunicación Publicitaria
30/09/2026

MONETARIO A CORTO PLAZO ■

Índice de liquidez * (Fuente : Amundi)

Ratio 24h	30,82%
Weekly ratio	45,11%

*** REGLAMENTO (UE) 2017/1131 sobre fondos monetarios**

Para los fondos del mercado monetario con valor liquidativo a corto plazo de baja volatilidad, al menos el 10% de sus activos tienen vencimiento diario o son acuerdos de recompra que pueden rescindirse con previo aviso. un día hábil o efectivo que se puede retirar con un día hábil de aviso; al menos el 30% de sus activos vencen semanalmente o consisten en acuerdos de recompra inversa que pueden rescindirse con un aviso de cinco días hábiles o efectivo que puede retirarse con un aviso de cinco días hábiles . Los activos con alto grado de liquidez, que pueden venderse y liquidarse en un día hábil y tienen un vencimiento residual de hasta 190 días, también pueden incluirse en activos con vencimiento semanal hasta el límite del 17,5%. ;

Para los fondos del mercado monetario a corto plazo de VLV a corto plazo, al menos el 7,5% de sus activos tienen vencimiento diario o consisten en acuerdos de recompra inversa que pueden ser rescindidos por aviso de un día hábil o efectivo que puede retirarse con un aviso de un día hábil; al menos el 15% de sus activos vencen semanalmente o consisten en acuerdos de recompra inversa que pueden rescindirse con un aviso de cinco días hábiles o efectivo que puede retirarse con un aviso de cinco días hábiles .

Su fondo presenta un riesgo de pérdida de capital. Su valor liquidativo puede fluctuar y el capital invertido no está garantizado. El fondo no podrá contar en ningún caso con un apoyo externo para garantizar o estabilizar su valor liquidativo. Invertir en un fondo monetario es distinto a invertir en depósitos bancarios.

AMUNDI EURO LIQUIDITY SHORT TERM RESPONSIBLE - E

INFORMES
Comunicación Publicitaria
30/09/2026

MONETARIO A CORTO PLAZO

Léxico ESG

Inversión Socialmente Responsable (ISR)

El ISR traduce los objetivos del desarrollo sostenible en las decisiones de inversiones añadiendo los criterios Medioambientales, Sociales y de Gobernanza (ESG) además de los criterios financieros tradicionales.

Criterios ESG

Se trata de criterios extrafinancieros utilizados para evaluar las prácticas Medioambientales, Sociales y la Gobernanza de las empresas, Estados o autoridades locales:

"E" de Medioambiente: niveles de consumo de energía y gas, gestión del agua y de los residuos, etc.
"S" de Social: Respeto por los derechos humanos, salud y seguridad en el trabajo, etc.
"G" de Gobernanza: independencia del Òrgano de Administración, respeto a los derechos de los accionistas, etc.

Escala de calificación ESG

Escala de notación de A (mejor nota) a G (nota menos buena)



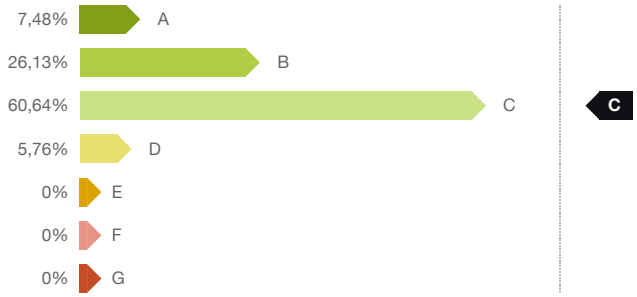
Calificación ESG promedio (Fuente: Amundi)

Calificación de criterios Ambientales, Sociales y de Gobernanza. Puede encontrar información sobre aspectos relacionados con la sostenibilidad en https://about.amundi.com/legal-documentation

Indice de referencia ESG

25% ICE BOFA 1-3 YEAR EURO NON-FINANCIAL INDEX + 75% ICE BOFA 1-3 YEAR EURO FINANCIAL INDEX

Portfolio Breakdown - ESG Rating



Puntuaciones y calificaciones ESG

	Cartera	Índice
E Score	1,28	0,95
S Score	0,85	0,52
G Score	1,09	0,34
ESG Score	1,23	0,69
ESG Rating c.	C	C

Average ESG score of the adjusted index for the Top 70% 1,14

Cobertura del análisis ESG[1] (Fuente : Amundi)

% de la cartera clasificada ESG[2]	100%

Etiqueta ISR

Puntuación de sostenibilidad (Fuente: Morningstar)



La puntuación de sostenibilidad es una calificación elaborada por Morningstar que mide de manera independiente el nivel de responsabilidad de un fondo en función de los valores en la cartera. Los rangos de calificación van desde muy bajo (1 Globo) hasta muy alto (5 Globos)

MorningstarSustainabilityRatingDate : **31/05/2026**

Fuente: Morningstar © Puntuación de sostenibilidad - basada en el análisis del riesgo ESG corporativo ofrecido por Sustainalytics y utilizada en el cálculo de la calificación de sostenibilidad de Morningstar. © 2026 Morningstar. Todos los derechos reservados. La información aquí incluida (1) es propiedad de Morningstar y/o de sus proveedores de contenidos; (2) no puede ser reproducida ni redistribuida; y (3) no se garantiza que sea exacta, exhaustiva ni actualizada. Ni Morningstar ni sus proveedores de contenido responden de los perjuicios o pérdidas derivados del uso de esta información. Las rentabilidades pasadas no garantizan los resultados futuros. Si desea más información sobre la calificación de Morningstar, visite su sitio web www.morningstar.com.

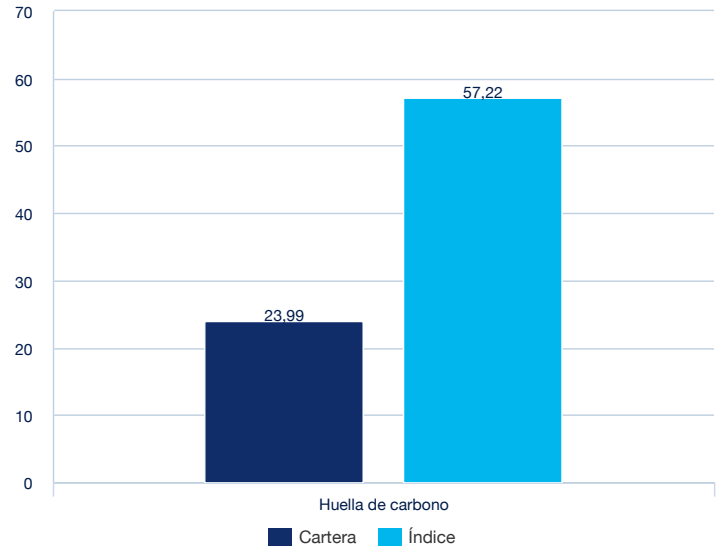
[1] Valores en circulación según criterios ESG, excluidos los activos en efectivo.

The decision of the investor to invest in the promoted fund should take into account all the characteristics or objectives of the fund.

Detalle de los indicadores Medioambientales, Sociales y de Gobernancia

Como complemento a la evaluación ESG global de la cartera y de las dimensiones E, S y G, el gestor utiliza indicadores de impacto para evaluar la calidad ESG del fondo respecto a los planes medioambientales, sociales, de buena gobernancia y de respeto de los derechos humanos. Para ello, se han seleccionado cuatro criterios de comportamiento y el fondo tiene como objetivo tener una cartera que presente un mejor comportamiento que el universo de inversión de referencia para al menos dos de los citados criterios.

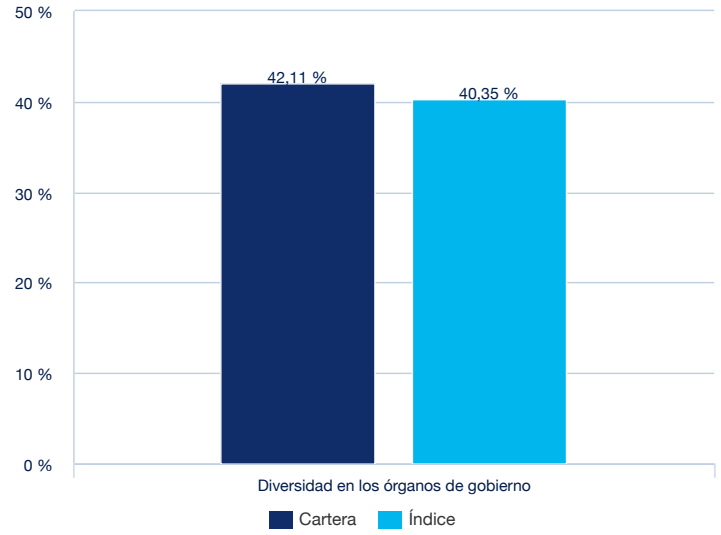
MEDIO AMBIENTE:Intensidad de carbono



Intensidad de GEI de las empresas participadas – tCO2eq/€m de ingresos
Fuente: Trucost

Tasa de cobertura (cartera / índice de referencia)	84,12%	97,21%

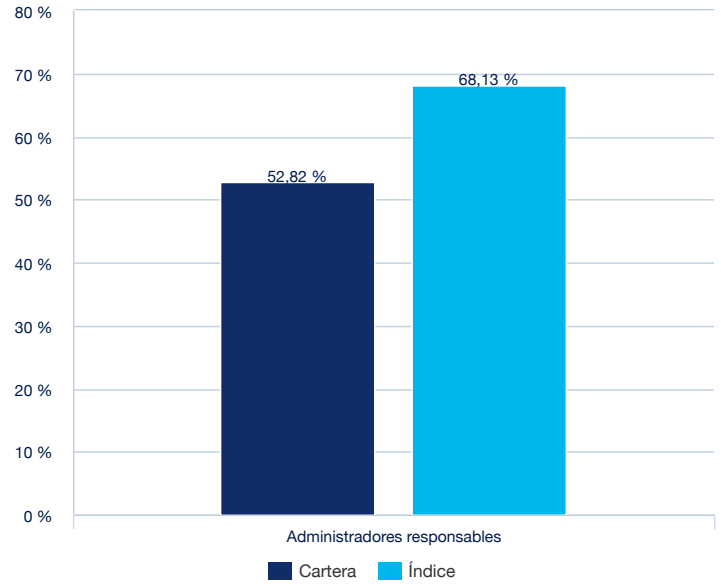
SOCIAL : Diversidad en los órganos de gobierno



Ratio mujeres/hombres en los órganos de gobierno de las empresas concernidas en porcentaje de número total de miembros
Fuente : Refinitv, ISS, MSCI

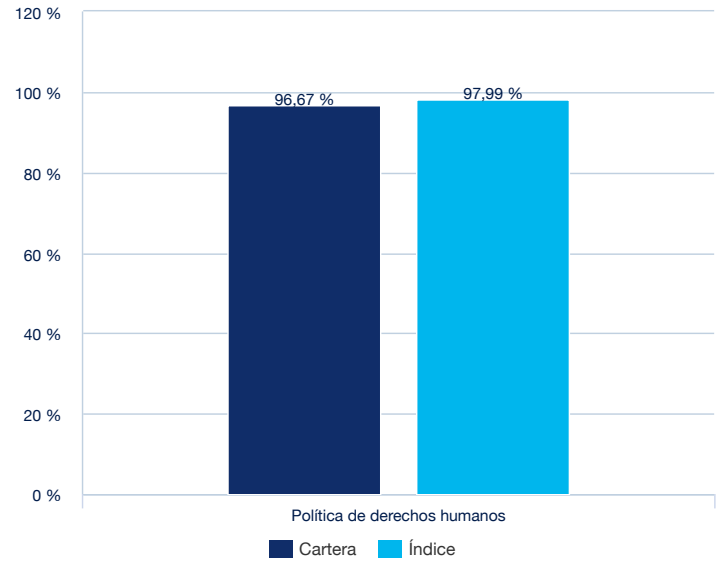
Tasa de cobertura (cartera / índice de referencia)	83,32%	98,79%

GOBIERNO: Independencia de la Junta Directiva



Tasa de cobertura (cartera / índice de referencia)	89,65%	87,60%

RESPETO A LOS DERECHOS HUMANOS: trabajo decente y libertad de asociación



Tasa de cobertura (cartera / índice de referencia)	89,65%	87,60%

fuentes y definiciones

Huella de carbono : La intensidad de GEI de la cartera se determina calculando la media ponderada de la intensidad total de las emisiones de gases de efecto invernadero de la cartera por millón de euros de volumen de negocios de las empresas de la cartera (t/Millón de euros de volumen de negocios). El indicador PAI considera todas las inversiones, lo que significa que el denominador se determina teniendo en cuenta todas las inversiones de la entidad. Las ponderaciones de la cartera se ajustan para tener en cuenta la cobertura incompleta de los datos. Amundi ha revisado su metodología y publica la totalidad de las emisiones de alcance 3, aunque siguen existiendo posibles sesgos e imprecisiones en los datos de emisiones de alcance 3. Asimismo, cabe señalar que Amundi ha cambiado de proveedor de datos para el cálculo del EVIC.

Diversidad en los órganos de gobierno : El porcentaje de diversidad de género del consejo de administración de la cartera se determina calculando la media ponderada de la cartera del porcentaje de miembros del consejo que son mujeres en las empresas participadas, expresado como porcentaje de todos los miembros del consejo. El indicador PAI considera las inversiones pertinentes, lo que significa que el denominador se determina teniendo en cuenta únicamente las inversiones concernidas por el indicador. Cuando la cobertura de la diversidad de género en los consejos de administración es inferior al 100 %, las ponderaciones de la cartera se ajustan para reflejar la cobertura incompleta de los datos.

Independencia del Consejo de Administración : porcentaje medio de consejeros independientes en el Consejo de Administración. Fuente: Refinitiv.

Indicador de respeto de los derechos humanos : porcentaje de empresas con una política que excluye el trabajo infantil forzoso u obligatorio, o que garantiza la libertad de asociación, aplicada universalmente e independientemente de las leyes locales. Fuente: Refinitiv.