

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 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.

Helix

un subfondo de la SICAV Schroder GAIA

Clase A Acumulación CHF Hedged (LU1809997015)

La gestión del fondo corre a cargo de Schroder Investment Management (Europe) S.A., miembro del grupo Schroders.

Objetivos y política de inversión

Objetivos

El objetivo del fondo es proporcionar un crecimiento del capital superior al de Secured Overnight Financing Rate (SOFR), una vez deducidas las comisiones, en un periodo de tres años, mediante la inversión en valores de renta variable de todo el mundo, lo que incluye los mercados emergentes. El Fondo podrá asimismo invertir en bonos, mercados de materias primas y divisas de todo el mundo, incluidos los mercados emergentes.

Política de inversión

El fondo se gestiona de forma activa e implementa un conjunto de estrategias diversificadas en varios mercados y clases de activos. El fondo invierte en valores de renta variable, bonos, divisas y productos básicos, así como en fondos de inversión que invierten en dichos instrumentos. El fondo podrá invertir hasta el 50% de sus activos en bonos con una calificación crediticia por debajo del grado de inversión (es decir, bonos con una calificación crediticia por debajo de grado de inversión según Standard & Poor's o cualquier calificación equivalente de otras agencias de calificación crediticia). El fondo podrá invertir hasta el 20 % de sus activos en valores respaldados por hipotecas y por activos. El fondo podrá invertir en bonos convertibles y bonos con warrants. Las inversiones en los mercados de productos básicos se realizarán, indirectamente, utilizando una combinación de índices de productos básicos y otros activos subyacentes elegibles. Las inversiones se realizarán directamente (a través de participaciones físicas) o indirectamente (a través de derivados). El fondo podrá utilizar derivados ampliamente, en posiciones largas y cortas y de manera continua, con el objetivo de obtener beneficios, reducir el riesgo o gestionar el fondo de manera más eficiente. El fondo contará con una exposición neta larga o neta corta cuando se combinen posiciones largas y cortas. El fondo podrá usar apalancamiento y mantener dinero en efectivo. El fondo podrá invertir hasta un 10 % de sus activos en fondos de inversión de capital variable y ETF. El fondo mantiene una puntuación absoluta positiva en materia de sostenibilidad, según

el sistema de calificación del gestor de inversiones. El Fondo no invierte ni directa ni indirectamente (a través de derivados de denominación única) en determinadas actividades, sectores o grupos de emisores que superan los límites indicados en la sección dedicada a la información sobre sostenibilidad del sitio web del Fondo, al que se puede acceder en www.schroders.com/en/lu/private-investor/gfc. Recomendación: Los inversores deberían buscar asesoramiento independiente para cerciorarse de que comprenden las técnicas empleadas por el gestor.

Índice de referencia

La rentabilidad del fondo se debe evaluar con respecto a su valor de referencia objetivo, que consiste en superar el tipo de financiación a un día garantizado (SOFR), después de comisiones, a lo largo de un periodo de tres años y en comparación con el índice HFRX EH: Equity Market Neutral Index y el índice MSCI AC World (Net TR) Index. Los valores de referencia de comparación solo se incluyen con fines de comparación de la rentabilidad y no influyen en la forma en que la gestora de inversiones invierte los activos del fondo. En relación con el índice MSCI AC World (Net TR) Index, se espera que el universo de inversión del fondo se correlacione directa o indirectamente en cierta medida con los componentes del valor de referencia de comparación. Los valores de referencia no tienen en cuenta las características medioambientales y sociales ni el objetivo sostenible (según corresponda) del fondo. Consulte el anexo III del folleto del fondo para obtener más información. La rentabilidad de esta clase de participaciones se compara con respecto a la rentabilidad de la clase de participaciones equivalente en la divisa no cubierta.

Frecuencia de la negociación

Puede redimir su inversión previa petición. Este fondo se negocia diariamente.

Política de distribución

Esta clase de acciones acumula beneficios recibidos por las inversiones del fondo, lo que significa que estos se mantienen en el fondo y su valor se refleja en el precio de la clase de acciones.

Perfil de riesgo y remuneración



El indicador del riesgo y la remuneración

La categoría de riesgo se fundamenta en el objetivo de riesgo del fondo y no existe garantía de que el fondo lo vaya a alcanzar. No se garantiza que la categoría de riesgo del fondo se mantenga fija y esta podrá cambiar a lo largo del tiempo. El hecho de que un fondo esté asignado a la categoría más baja no significa que la inversión esté libre de riesgo. El fondo se encuentra en esta categoría porque puede asumir riesgos mayores con el fin de obtener una mayor remuneración y su precio podrá aumentar o disminuir en consecuencia.

Factores de riesgo

Riesgo de sostenibilidad: El fondo tiene características medioambientales y/o sociales. Esto significa que puede tener una exposición limitada a algunas sociedades, industrias o sectores, y que puede renunciar a ciertas oportunidades de inversión, o deshacerse de ciertas participaciones, que no se ajusten a sus criterios de sostenibilidad, que han sido seleccionados por el gestor de inversiones. El fondo podrá invertir en sociedades que no reflejen las convicciones ni los valores de ningún inversor en particular. Riesgo de multigestor: el fondo asigna capital a varias estrategias gestionadas por gestores de cartera independientes que no coordinarán las decisiones de inversión, lo que puede dar lugar a exposiciones de riesgo concentradas o compensadas. Riesgo de crédito: el declive en la salud financiera de un emisor podría provocar la bajada del valor de sus bonos o una pérdida de su valor. Riesgo de divisas: el fondo puede perder valor como resultado de movimientos en los tipos de cambio extranjeros. Riesgo de divisas/clase de acciones con cobertura: cabe la posibilidad de que la cobertura de la clase de acciones no sea totalmente efectiva y que persista una exposición residual a las divisas. El coste asociado a la cobertura puede

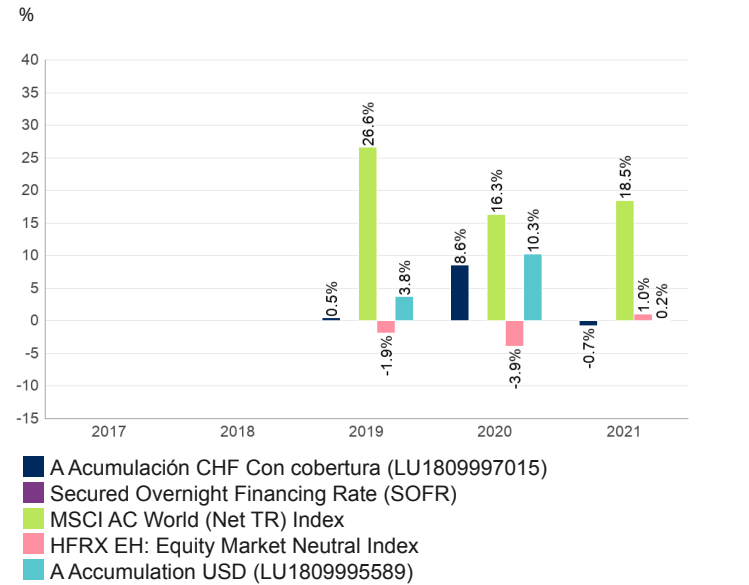
afectar a la rentabilidad, y las posibles ganancias pueden ser menores que en las clases de acciones sin cobertura. Riesgo de Stock Connect: el fondo puede invertir en acciones "A" de China a través del Shanghai-Hong Kong Stock Connect y el Shenzhen-Hong Kong Stock Connect, lo que puede generar riesgos de liquidación y vencimiento, regulatorios, operativos y de contraparte. Riesgo eventual: el fondo tomará posiciones significativas en empresas que formen parte de fusiones, adquisiciones, reorganizaciones y otros eventos corporativos. Es posible que estas no se desarrollen como se prevé, lo que puede suponer pérdidas para el fondo. Multiestrategia: El fondo puede estar expuesto a diversos riesgos. Entre estos se incluyen los riesgos relacionados con bonos de alta rentabilidad, bonos de titulización de activos y de titulización hipotecaria, bonos convertibles contingentes, mercados emergentes y fronterizos, y pequeñas empresas. Esto, a su vez, puede generar riesgos relacionados con lo siguiente: tipo de interés, crédito, divisas y liquidez. Riesgo de tipo de interés: el fondo puede perder valor como consecuencia directa de los cambios en los tipos de interés. Riesgo de liquidez: en condiciones de mercado adversas, puede que el fondo no sea capaz de vender un valor a su valor completo o que no pueda venderlo en absoluto. Esto podría afectar el rendimiento y provocar que el fondo aplazara o suspendiera el reembolso de sus acciones. Riesgo operativo: los procesos operativos, incluidos los relacionados con la custodia de activos, pueden fallar. Esto puede suponer pérdidas para el fondo. Riesgo de rentabilidad: los objetivos de inversión expresan un resultado previsto, pero no hay garantía alguna de que se vaya a alcanzar dicho resultado. En función de las condiciones del mercado y del entorno macroeconómico, los objetivos de inversión pueden resultar más difíciles de lograr. IBOR: la transición de los mercados financieros del uso de tipos de oferta interbancaria (IBOR) a tipos de referencia alternativos puede afectar a la valoración de determinadas participaciones y, en consecuencia, a la liquidez de determinados instrumentos. Esto puede afectar a la rentabilidad de la inversión del fondo. Riesgo de derivados: los derivados se pueden utilizar para gestionar la cartera de forma eficiente. El fondo también puede invertir materialmente en derivados

(por ejemplo, mediante técnicas de venta en corto y apalancamiento) con el fin de obtener rentabilidad. un derivado puede no rendir como se espera, generar

Gastos

Gastos no recurrentes percibidos con anterioridad o con posterioridad a la inversión	
Gastos de entrada	3.00%
Gastos de salida	Ninguna
Este es el máximo que puede detraerse de su capital antes de proceder a la inversión o antes de que se pague el producto de la inversión.	
Gastos detraídos del fondo a lo largo de un año	
Gastos corrientes	2.46%
Gastos detraídos del fondo en determinadas condiciones específicas	
Comisión de rentabilidad	
Sujeto al principio de «cota máxima», un 20.00% de la rentabilidad positiva superior a la esperada de la clase de acciones por encima de la del tipo de financiación a un día garantizado (SOFR). Consulte el folleto para obtener más información. En el último ejercicio financiero, la comisión de rentabilidad fue del 1.46 % del fondo.	

Rentabilidad histórica



Información práctica

Depositorio: Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A.

Información adicional: Para obtener información adicional sobre el fondo, como el folleto, el último informe anual, cualquier informe semestral posterior y el último precio de las acciones, póngase en contacto con la sociedad gestora del fondo en 5, rue Höhenhof, L-1736 Senningerberg, Luxemburgo o visite www.schroders.lu/kiids. Pueden obtenerse en inglés, flamenco, francés, alemán, italiano y español de forma gratuita.

Legislación fiscal: El fondo está sujeto a la legislación fiscal de Luxemburgo, lo cual puede afectar a su situación fiscal personal.

Responsabilidad: Schroder Investment Management (Europe) S.A. únicamente incurrirá en responsabilidad por las declaraciones contenidas en el presente documento que resulten engañosas, inexactas o incoherentes frente a las correspondientes partes del folleto del fondo.

Fondo paraguas: este fondo es un compartimento de un fondo paraguas cuyo nombre aparece al principio del presente documento. El folleto y los informes periódicos se elaboran para la totalidad del fondo paraguas. Para

pérdidas superiores al coste del derivado y suponer pérdidas para el fondo.

Los gastos que usted soporta están destinados a sufragar los costes de funcionamiento del Fondo, incluidos los costes de comercialización y distribución. Estos gastos reducen el potencial de crecimiento de su inversión. Los gastos de salida y entrada indicados representan las cifras máximas y es posible que en algunos casos se deba pagar un importe inferior. Puede consultar los gastos de salida y entrada reales a su asesor financiero. La cifra de gastos se basa en los gastos del pasado año para el ejercicio finalizado en diciembre de 2021 y puede variar de un año a otro. Puede consultar información adicional sobre los gastos en el apartado 3 del folleto del Fondo.

La rentabilidad histórica no es un indicador de la rentabilidad futura y puede no repetirse. El valor de las inversiones podría tanto disminuir como aumentar y es posible que no recupere el importe que invirtió inicialmente. El diagrama muestra la rentabilidad en francos suizos (CHF) después de los gastos corrientes y una vez pagados los costes de transacción de la cartera y la comisión de rentabilidad. Los gastos de entrada no se incluyen en los cálculos de la rentabilidad histórica. La rentabilidad del Índice de referencia se muestra en la moneda base del fondo. El fondo se creó el 23/05/2018. La clase de acciones se creó el 30/11/2018. Tenga en cuenta que el objetivo de inversión, la política y los índices de referencia del fondo se modificaron el 1 de marzo de 2022. La rentabilidad histórica que se muestra en la tabla anterior se basa en el objetivo de inversión, la política y los índices de referencia del fondo (índices de referencia objetivo: MSCI AC World [Net TR] Index y HFRX EH: Equity Market Neutral Index) aplicables antes de dicha fecha. En lo sucesivo, en la tabla se mostrará la rentabilidad histórica anotada a partir de dicha fecha en función del objetivo de inversión, la política y los índices de referencia nuevos (índice de referencia objetivo: Secured Overnight Financing Rate [SOFR]) (índices de referencia de comparación: MSCI AC World [Net TR] Index y HFRX EH: Equity Market Neutral Index).

proteger a los inversores, los activos y pasivos de cada compartimento se separan de los de los demás compartimentos por ley.

Canjes: sujeto a ciertas condiciones, puede solicitar el canje de su inversión por otra clase de acciones del fondo u otro fondo de Schroder. Consulte el folleto para obtener más información.

Política de remuneración: Podrá encontrar un resumen de la política de remuneración de Schroders y otra información relacionada en www.schroders.com/remuneration-disclosures. Hay copias impresas disponibles de forma gratuita previa solicitud. En la política se describen los métodos para calcular tanto la remuneración como los beneficios, así como las identidades de los responsables de adjudicar ambos.

Glosario: Puede consultarse una explicación sobre algunos de los términos empleados en el presente documento en www.schroders.lu/kiid/glossary.

Gastos de distribución: El nivel de los gastos de distribución en determinadas jurisdicciones puede incidir en la capacidad del gestor de inversiones para alcanzar el objetivo de inversión del fondo en todas las clases de acciones, una vez deducidas las comisiones.