

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.

BlueTrend

un subfondo de la SICAV Schroder GAIA

Clase C Acumulación cobertura en BRL (LU2251782590)

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 una rentabilidad positiva, una vez deducidas las comisiones, durante un periodo de tres años, mediante la inversión en bonos, valores de renta variable, divisas y mercados de materias primas.

Política de inversión

El fondo se gestiona de forma activa e invierte directamente (a través de participaciones físicas) y/o indirectamente (a través de derivados) en bonos, valores de renta variable, divisas y mercados de materias primas a nivel mundial, así como en fondos de inversión que invierten en dichos instrumentos.

El gestor de inversiones ha establecido un sofisticado sistema informatizado que, por medio de un análisis cuantitativo, identifica las tendencias y patrones de precios con el objetivo de determinar las operaciones que se van a realizar.

El gestor de inversiones pretende aprovechar las oportunidades en las que los precios muestran tendencias ascendentes o descendentes persistentes e identificables.

Las inversiones en materias primas se realizarán indirectamente mediante una combinación de bonos vinculados, opciones, swaps y/o índices de materias primas.

El fondo puede 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 podrá usar apalancamiento y mantener dinero en efectivo. El fondo podrá, excepcionalmente, mantener hasta el 100 % de sus activos en efectivo. El fondo podrá invertir hasta el 10 % de sus activos en fondos de inversión de

tipo abierto.

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 evaluará con respecto a su valor de referencia objetivo, que consiste en generar una rentabilidad positiva a lo largo de un periodo de tres años, y en comparación con el índice HFRX Macro: Systematic Diversified CTA. El valor de referencia de comparación solo se incluye con fines de comparación de la rentabilidad y no influye en la forma en que la gestora de inversiones invierte los activos del fondo. La gestora de inversiones invierte a su entera discreción y no existen restricciones en la medida en que la cartera y la rentabilidad del Fondo puedan desviarse del valor de referencia de comparación. El valor de referencia objetivo se ha seleccionado porque el objetivo del fondo es lograr la rentabilidad de dicho valor de referencia tal y como se establece en el objetivo de inversión. El valor de referencia de comparación se ha seleccionado porque la gestora de inversiones considera que constituye un instrumento de comparación adecuado a efectos de rentabilidad, teniendo en cuenta el objetivo y la política de inversión del fondo. La rentabilidad de esta clase de participaciones se compara con la de la clase de participaciones equivalente sin cobertura de divisas.

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

Menor riesgo

Posibilidades de menor remuneración

Mayor riesgo

Posibilidades de mayor 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 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 participaciones con cobertura: cabe la posibilidad de que la cobertura de la clase de participaciones 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 participaciones sin cobertura.

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

Gastos

Gastos no recurrentes percibidos con anterioridad o con posterioridad a la inversión

Gastos de entrada 1.00%

Gastos de salida Ninguna

Este es el máximo que puede detrarse 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 1.50%

Gastos detraídos del fondo en determinadas condiciones específicas

Comisión de rentabilidad

Sujeto al principio de cota máxima, un 10.00 % de la rentabilidad positiva de la clase de acciones. Consulte el folleto para obtener más información. En el último ejercicio financiero, la comisión de rentabilidad fue del 0.67 % del fondo.

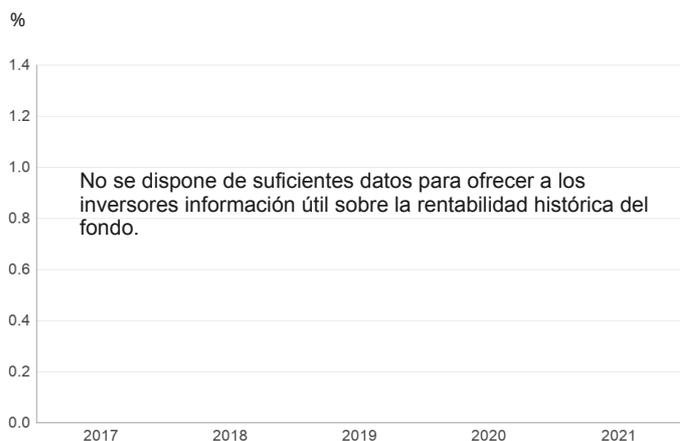
Los gastos que usted soporta están destinados a sufragar los costes de funcionamiento del Fondo, incluidos los costes de comercialización y distribución. Estos gastos reducen el potencial de crecimiento de su inversión.

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.

Rentabilidad histórica



Tenga en cuenta que el valor de referencia de comparación del fondo se modificó el 1 de enero de 2022. La rentabilidad histórica que se muestra en la tabla anterior se basa en el valor de referencia del fondo (valor de referencia de comparación: índice MSCI World [rentabilidad total neta]) aplicable antes de dicha fecha. En lo sucesivo, en la tabla se mostrará la rentabilidad histórica anotada a partir de dicha fecha en función del nuevo valor de referencia (valor de referencia de comparación: índice HFRX Macro: Systematic Diversified CTA).

■ Con cobertura en BRL C Acumulación con cobertura en USD (LU2251782590)

■ HFRX Macro: Systematic Diversified CTA Index

■ C Accumulation USD (LU1293073315)

■ MSCI World (Net TR) Index

El fondo se creó el 09/12/2015.

La clase de acciones se creó el 21/01/2021.

Los datos de rentabilidad solo están disponibles desde la creación de la respectiva clase de acciones.

Información práctica

Depositario: 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

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.