

FINALIDAD

Este documento le proporciona información fundamental que debe conocer sobre este producto de inversión. No se trata de material comercial. Es una información exigida por ley para ayudarle a comprender la naturaleza, los riesgos, los costes y los beneficios y pérdidas potenciales de este producto y para ayudarle a compararlo con otros productos.

PRODUCTO

Absolute Return Strategies Fund (el “Subfondo”) Clase A (las “Acciones” o el “PRIIP”) CaixaBank Global SICAV (el “Fondo”) ISIN: LU2597981757

Productor del PRIIP: CaixaBank Asset Management Luxembourg S.A. **Dirección:** 46b, avenue J.F. Kennedy L-1855 Luxembourg, Luxembourg

Sitio web: <https://www.caixabankamlux.com/>

Para más información, llame al (+352) 20 60 13 83 20

La Commission de Surveillance du Secteur Financier (“CSSF”) es responsable de supervisar a CaixaBank Asset Management Luxembourg S.A. en relación con este documento de datos fundamentales. Este PRIIP está autorizado en Luxemburgo y supervisado por la CSSF. CaixaBank Asset Management Luxembourg S.A. está autorizada en Luxemburgo y regulada por la Commission de Surveillance du Secteur Financier. CaixaBank Asset Management Luxembourg S.A. forma parte de CaixaBank Group.

Fecha de elaboración del documento de datos fundamentales:
21/02/2024

¿QUÉ ES ESTE PRODUCTO?

Tipo

Las acciones son una clase de acciones (las “**Acciones**”) del Absolute Return Strategies Fund (el “**Subfondo**”), un subfondo de CaixaBank Global SICAV (el “**Fondo**”). El Fondo está constituido como sociedad anónima (société anonyme) con arreglo a la ley luxemburguesa de 10 de agosto de 1915 sobre sociedades mercantiles, en su versión vigente, y es una sociedad de inversión de capital variable (société d’investissement à capital variable). El Fondo se considera un organismo de inversión colectiva en valores mobiliarios (OICVM) en el sentido de la ley luxemburguesa de 17 de diciembre de 2010 relativa a los organismos de inversión colectiva. El Fondo ha designado a CaixaBank Asset Management Luxembourg S.A. como su sociedad gestora (la “**Sociedad Gestora**”). El Subfondo es un subfondo de un fondo de inversión, cuyo rendimiento dependerá del rendimiento de su cartera, tal como se describe con más detalle en la sección “Objetivos” de este documento de datos fundamentales (“**DFI**”).

Plazo

El Fondo, el Subfondo y las Acciones se crearon por un periodo indefinido. El Fondo puede disolverse mediante una resolución de la junta general de accionistas, tal y como se describe con más detalle en los estatutos del Fondo (los “**Estatutos**”). El Productor del PRIIP no puede cancelar unilateralmente el Fondo, el Subfondo o las Acciones.

Objetivos

El objetivo de inversión del Subfondo es lograr la revalorización del capital con una rentabilidad absoluta independientemente de la dirección del mercado y del perfil de riesgo conservador mediante la inversión en un conjunto mixto de activos (incluidos valores de renta variable, valores de renta fija, materias primas, instrumentos del mercado monetario y otros OICVM, incluidos fondos cotizados (“**ETF**”) y el uso de diferentes estrategias de inversión alternativas líquidas. El Subfondo se centrará principalmente en estrategias de inversión alternativas líquidas no direccionales (valor relativo y macro global). Sin embargo, el Subfondo puede emplear diversas estrategias de inversión alternativas, como renta variable “long/short”, basadas en oportunidades (“event driven”), futuros gestionados y macro global. CaixaBank Asset Management SGIIC, SAU (el “**Gestor de Inversiones**”) pretende alcanzar el objetivo del Fondo asignando las respectivas partes de la cartera del Subfondo a diferentes subgestores de inversiones que seleccionarán activos en función de su experiencia en la implementación de la estrategia pertinente, las condiciones actuales del mercado y los objetivos de inversión del Subfondo. Al ejecutar cada una de estas estrategias, los subgestores de inversiones seleccionarán y asignarán los activos globalmente sin establecer límites sobre ninguna clase de activos en particular (renta variable o renta fija, por ejemplo), región geográfica o sector y cumpliendo con los requisitos de diversificación de OICVM pertinentes. Algunas de las principales estrategias de inversión que se utilizarán incluyen estrategias de renta variable long short, estrategias de valor relativo, estrategias basadas en oportunidades (“event driven”), estrategias macro globales,

futuros gestionados y multiestrategia. En circunstancias excepcionales en las que el Gestor de Inversiones o cualquier subgestor de inversiones prevea condiciones adversas de mercado, económicas, políticas o de otro tipo, el Subfondo podrá invertir principalmente en instrumentos del mercado monetario o equivalentes o dejar una parte significativa de sus activos sin invertir con fines defensivos. Hacerlo podría ayudar al Subfondo a evitar pérdidas, pero podría suponer también la pérdida de oportunidades. Aunque el Subfondo concentrará sus inversiones en países de la Organización para la Cooperación y el Desarrollo Económicos (“**OCDE**”), el Subfondo también puede invertir en valores de empresas ubicadas en países de mercados emergentes y en títulos de sus respectivos gobiernos, lo que puede implicar un riesgo adicional, en relación con la inversión en economías más desarrolladas. El Subfondo podrá invertir en activos denominados en cualquier divisa, sin limitaciones. El Subfondo también puede mantener activos líquidos con carácter accesorio, como efectivo en depósitos bancarios a la vista mantenidos en cuentas corrientes accesibles en cualquier momento, hasta el 20 % de su patrimonio neto, que solo podrán superar el límite del 20 % en caso de condiciones de mercado excepcionalmente desfavorables según se describen más detalladamente en el folleto. Las Acciones son de capitalización: todos los ingresos generados por el Subfondo se reinvierten para aumentar el valor de las Acciones. Los inversores pueden reembolsar sus Acciones en el Subfondo cada día hábil en Luxemburgo. Teniendo en cuenta el periodo de mantenimiento a corto plazo y las características de las inversiones, la rentabilidad del Subfondo depende de la rentabilidad de las inversiones a

lo largo del tiempo. Un rendimiento positivo de las inversiones dará lugar a un rendimiento positivo del Subfondo. Del mismo modo, un rendimiento negativo de las inversiones producirá un rendimiento negativo del Subfondo. El Subfondo persigue una estrategia de inversión gestionada activamente. El Subfondo hace referencia a HFRU Equity Hedge (el "Índice de Referencia"). El Índice de Referencia se utiliza únicamente como referencia para comparar la rentabilidad del Subfondo. El objetivo de inversión del Subfondo no es replicar el rendimiento del Índice de Referencia. No existen restricciones en cuanto a la medida en que la cartera y la rentabilidad del Subfondo pueden desviarse de las del Índice de Referencia. Las inversiones subyacentes del Subfondo no tienen en cuenta los criterios de la Unión Europea ("UE") para actividades económicas medioambientalmente sostenibles¹. El depositario del Fondo es BNP Paribas, Luxembourg branch. Este documento de datos fundamentales (DFI) está disponible en inglés y español. La última cotización de las

Acciones está disponible en el domicilio social del Fondo, 60, avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg. El Fondo es un fondo paraguas que ofrece varios subfondos cuyos activos y pasivos están legalmente segregados entre sí. Dicho documento solo describe la clase A del Absolute Return Strategies Fund. También hay otras clases disponibles dentro de este Subfondo. Puede consultarse más información sobre dichas clases en el folleto de CaixaBank Global SICAV. Se permiten los canjes entre subfondos/clases de acciones dentro de CaixaBank Global SICAV. Los informes periódicos y el folleto, según se describen con más detalle en la sección "Otros datos de interés" a continuación, se preparan para el Fondo en su conjunto. Para obtener más información, puede solicitar copias del folleto y de los últimos informes anuales y semestrales de todo el Fondo, así como otra información práctica disponible en inglés, en el domicilio social del Fondo, 60, avenue J. F. Kennedy, L-1855 Luxembourg, y en el sitio web <https://www.caixabankamlux.com/>.

Inversor minorista al que va dirigido

Las Participaciones están dirigidas a inversores minoristas que (i) tengan suficiente experiencia pasada y conocimiento teórico de este tipo de inversión, lo que les permite evaluar el riesgo de invertir en este tipo de producto, (ii) tengan un horizonte de inversión a corto plazo de 2 años y (iii) tengan suficientes recursos para poder soportar la pérdida de todo su capital al invertir en las Participaciones. La necesidad de que el inversor minorista pueda soportar la pérdida de toda su inversión se debe a varios riesgos, incluidos el riesgo de mercado y el riesgo de crédito, que pueden afectar considerablemente al rendimiento de su inversión. Estos riesgos se describen con más detalle en la sección "¿Qué riesgos corro y qué podría obtener a cambio?" a continuación. Los inversores deben estar dispuestos a asumir un riesgo de 2 en una escala de 7, o sea un riesgo bajo.

¿QUÉ RIESGOS CORRO Y QUÉ PODRÍA OBTENER A CAMBIO?

Indicador sintético de riesgo



El indicador de riesgos presupone que usted mantendrá el producto durante 2 años. El riesgo real puede variar considerablemente en caso de salida anticipada, por lo que es posible que recupere menos dinero.

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.

Hemos clasificado este producto en la clase de riesgo 2 en una escala de 7, o sea un riesgo bajo.

Esta evaluación califica la posibilidad de sufrir pérdidas en rentabilidades

futuras como baja, y la probabilidad de que una mala coyuntura de mercado influya en nuestra capacidad de pagarle como muy improbable.

Puede consultarse más información en las secciones "Consideraciones sobre riesgos" y "Conflicto de Interés" del folleto del Fondo.

Este producto no incluye protección alguna contra la evolución futura del mercado, por lo que podría perder una parte o la totalidad de su inversión.

Si no se puede pagarle lo que se le debe, podría perder toda su inversión.

ESCENARIOS DE RENTABILIDAD

Lo que obtenga de este producto dependerá de la evolución futura del mercado, la cual es incierta y no puede predecirse con exactitud. Los escenarios desfavorable, moderado y favorable que se muestran son ilustraciones basadas en la rentabilidad más baja, media y más alta de un valor de referencia adecuado durante los últimos 10 años. Los escenarios que se muestran son ilustraciones basadas en resultados pasados y en determinadas hipótesis.

Período de mantenimiento recomendado: 2 años

Ejemplo de inversión: € 10.000

Escenarios

		En caso de salida después de 1 año	En caso de salida después de 2 años
Mínimo	No hay un rendimiento mínimo garantizado. Podría perder parte o la totalidad de su inversión.		
Tensión	Lo que podría recibir tras deducir los costes	€ 7.120	€ 7.960
	Rendimiento medio cada año	-28,85 %	-10,78 %
Desfavorable	Lo que podría recibir tras deducir los costes	€ 8.210	€ 8.050
	Rendimiento medio cada año	-17,95 %	-10,26 %
Moderado	Lo que podría recibir tras deducir los costes	€ 9.250	€ 8.950
	Rendimiento medio cada año	-7,50 %	-5,38 %
Favorable	Lo que podría recibir tras deducir los costes	€ 10.150	€ 9.570
	Rendimiento medio cada año	1,48 %	-2,17 %

Las cifras presentadas incluyen todos los costes del producto propiamente dicho, pero es posible que no incluyan todos los costes que usted deba pagar a su asesor o distribuidor. Las cifras no tienen en cuenta su situación fiscal personal, que también puede influir en la cantidad que reciba.

El escenario de tensión muestra lo que usted podría recibir en circunstancias extremas de los mercados.

Desfavorable: Este tipo de escenario se produjo para una inversión en un valor de referencia adecuado entre octubre 2021 y octubre 2023.

Moderado: Este tipo de escenario se produjo para una inversión en un valor de referencia adecuado entre agosto 2016 y agosto 2018.

Favorable: Este tipo de escenario se produjo para una inversión en un valor de referencia adecuado entre marzo 2020 y marzo 2022.

¿QUÉ PASA SI CAIXABANK ASSET MANAGEMENT LUXEMBOURG S.A. NO PUEDE PAGAR?

El inversor no puede enfrentarse a una pérdida financiera como consecuencia del impago por parte del Productor del PRIIP.

Los activos del Fondo están custodiados por su depositario, BNP Paribas, Luxembourg Branch (el "Depositario"). En caso de insolvencia del Productor del PRIIP, los activos del Fondo en custodia del Depositario no se verán afectados. Sin embargo, en caso de insolvencia del Depositario, o de alguien que actúe en su nombre, el Fondo puede sufrir una pérdida financiera. No obstante, este riesgo se ve mitigado en cierta medida por el hecho de que el Depositario está obligado por la ley y las normativas a segregar sus propios activos de los activos del Fondo. El Depositario también será responsable ante el Fondo por cualquier pérdida derivada, entre otras cosas, de su negligencia, fraude o incumplimiento intencionado de sus obligaciones (sujeto a ciertas limitaciones según se establezca en el acuerdo celebrado con el Depositario).

¹ Según el Reglamento (UE) 2020/852 ("SFDR"), este producto pertenece a la categoría del artículo 6.

Las pérdidas no están cubiertas por ningún régimen de compensación o garantía para los inversores.

¿CUÁLES SON LOS COSTES?

La persona que le asesore sobre este producto o se lo venda puede cobrarle otros costes. En tal caso, esa persona le facilitará información acerca de estos costes y de la incidencia que tienen en su inversión.

Costes a lo largo del tiempo

Los cuadros muestran los importes que se deducen de su inversión para cubrir diferentes tipos de costes. Estos importes dependen de cuánto invierte, de cuánto tiempo mantiene el producto y de lo buenos que sean los resultados del producto. Los importes indicados aquí ilustran un ejemplo de inversión de una determinada cuantía durante diferentes períodos de inversión posibles. Hemos partido de los siguientes supuestos:

— El primer año recuperaría el importe invertido (rendimiento anual del 0%). En relación con los demás períodos de mantenimiento, hemos supuesto que el producto evoluciona tal como muestra el escenario moderado.

— Se invierten 10.000 €

	En caso de salida después de 1 año	En caso de salida después de 2 años
Costes totales	€ 793	€ 1.078
Incidencia anual de los costes (*)	8,3 %	5,5 % cada año

(*) Refleja la medida en que los costes reducen su rendimiento cada año a lo largo del período de mantenimiento. Por ejemplo, muestra que, en caso de salida al término del período de mantenimiento recomendado, el rendimiento medio que se prevé que obtendrá cada año será del 0,1% antes de deducir los costes y del -5,4% después de deducir los costes.

Estas cifras incluyen la comisión de distribución máxima que puede cobrar la persona que le vende el producto (5% del importe invertido). Esta persona le informará de la comisión de distribución real.

Composición de los costes

Costes únicos de entrada o salida.	En caso de salida después 1 año
Costes de entrada	No cobramos comisión de entrada. € 500
Costes de salida	No cobramos una comisión de salida por este producto. € 0
Costes corrientes deducidos cada año	
Comisiones de gestión y otros costes administrativos o de funcionamiento	2,55% del valor de su inversión al año. Se trata de una estimación basada en los costes reales del último año. € 242
Costes de operación	0,53% del valor de su inversión al año. Se trata de una estimación de los costes en que incurrimos al comprar y vender las inversiones subyacentes del producto. El importe real variará en función de la cantidad que compremos y vendamos. € 50
Costes accesorios deducidos en condiciones específicas	
Comisiones de rendimiento	No se aplica ninguna comisión de rendimiento a este producto. € 0

¿CUÁNTO TIEMPO DEBO MANTENER LA INVERSIÓN, Y PUEDO RETIRAR DINERO DE MANERA ANTICIPADA?

Período de mantenimiento recomendado: 2 años

El Subfondo está dirigido a inversores con una alta tolerancia al riesgo que adopten una perspectiva de revalorización del capital a corto/medio plazo y, por tanto, estén dispuestos a inmovilizar sus ahorros durante un período de mantenimiento recomendado de 2 años.

Puede reembolsar su inversión en cualquier momento durante este período o mantener la inversión más tiempo. Los inversores pueden reembolsar sus acciones en el Subfondo cualquier día hábil en Luxemburgo. El reembolso antes del período de mantenimiento recomendado puede aumentar el riesgo de retornos de inversión más bajos.

¿CÓMO PUEDO RECLAMAR?

Si desea presentar una reclamación en relación con las Acciones o la conducta del Productor del PRIIP, póngase en contacto con nosotros como se indica a continuación. Cualquier reclamación relativa a la conducta de su agente de distribución debe dirigirse a dicho agente de distribución, con una copia a CaixaBank Asset Management Luxembourg S.A., utilizando los datos de contacto que se indican a continuación:

CaixaBank Asset Management Luxembourg S.A.

A/A: Emmanuelle Lemarquis (Complaints Handling Officer)

46b, avenue J.F. Kennedy

L-1855 Luxembourg

Correo electrónico: compliance@caixabankamlux.com

OTROS DATOS DE INTERÉS

La información contenida en este DFI se complementa con los estatutos y el folleto, que se proporcionarán a los inversores minoristas antes de la suscripción. Puede obtenerse más información sobre el Fondo, incluida una copia del folleto, del último informe anual y cualquier informe semestral posterior en inglés en <https://www.caixabankamlux.com/> de forma gratuita. El DFI está disponible en el sitio web del Productor del PRIIP: <https://www.caixabankamlux.com/>. Se puede proporcionar una copia en papel del DFI previa solicitud, de forma gratuita, en el domicilio social del Fondo, 60, avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg. Dado que aún no hay datos de rendimiento disponibles para un año completo, no hay datos suficientes para proporcionar una indicación útil de la rentabilidad histórica en este momento. Los cálculos de los escenarios de rentabilidad anteriores están disponibles en <https://www.caixabankamlux.com/>.