



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.

SYSTEMATIC ALPHA El Subfondo

un subfondo de Alma Platinum IV (el "Fondo")

Clase I5C-U USD – LU1125015336

Productor del PRIIP: Alma Capital Investment Management

Para más información, visite <https://www.almacapital.com> o llame al +352 28 84 54 10

La Commission de Surveillance du Secteur Financier (la «CSSF») en Luxemburgo es responsable de la supervisión de Alma Capital Investment Management en relación con este documento de datos fundamentales.

El Subfondo está autorizado en Luxemburgo y está regulado por la CSSF.

Este producto está gestionado por Alma Capital Investment Management, entidad autorizada en Luxemburgo y supervisada por la CSSF.

Datos exactos a: 20 de febrero de 2023

¿Qué es este producto?

Tipo

- Este producto es una clase de acciones del Subfondo y está denominado en USD. El Fondo Alma Platinum IV es una sociedad de inversión de tipo abierto con capital variable y cumple los requisitos para ser considerado un Organismo de Inversión Colectiva en Valores Mobiliarios («OICVM»), de conformidad con la Parte I de la Ley de Luxemburgo, de 17 de diciembre de 2010, relativa a los organismos de inversión colectiva (la «Ley de fondos de inversión»), que transpone la Directiva 2009/65/CE sobre OICVM.
- Como fondo de inversión, la rentabilidad del Subfondo depende de la rentabilidad de sus activos subyacentes.

Objetivos

Objetivo de inversión

- El objetivo del Subfondo es lograr la revalorización del capital a largo plazo aumentando la exposición a una gama de instrumentos financieros (derivados) de conformidad con una estrategia de negociación de base informática (la «Estrategia») diseñada por Winton Capital Management Limited («Winton»). Estas inversiones podrán incluir derivados ligados a materias primas (como energía, metales y productos agrícolas), índices de renta variable, deuda negociable (bonos), tipos de interés y divisas.

Política de inversión

- En concreto, el Subfondo podrá invertir en (i) contratos en los que una parte acuerda vender o comprar activos elegibles en el futuro a un precio determinado dentro de un plazo fijado (contratos de futuros) y contratos en los que una parte tiene la opción de comprar o vender contratos de futuros a un precio determinado dentro de un plazo fijado (opciones), que se negocien en mercados organizados, (ii) contratos de divisas, (iii) derivados extrabursátiles (OTC) que ofrecen exposición a índices financieros y/o activos elegibles (en su conjunto, la «Cartera de Derivados»). Winton gestionará la Cartera de Derivados.
- Además, el Subfondo realizará inversiones en valores mobiliarios, incluidos valores mobiliarios ligados a materias primas elegibles, tal y como se requiere para que, en su conjunto, las inversiones del Subfondo en la Cartera de Derivados y los valores mobiliarios hagan efectiva la Estrategia. State Street Global Advisors Limited gestionará los valores mobiliarios.
- El Subfondo utilizará efectivo para satisfacer las obligaciones de proporcionar activos en forma de garantía, así como las obligaciones de liquidación que debe satisfacer el Subfondo en relación con la cartera de derivados.
- El Subfondo tratará de destinar el exceso de efectivo a depósitos y/o realizar inversiones en instrumentos monetarios.
- El Subfondo, calculado en dólares estadounidenses, podrá utilizar técnicas de cobertura para intentar reducir el efecto de las fluctuaciones de cambio de divisas en los casos en que las inversiones están denominadas en divisas distintas al dólar estadounidense.
- El Subfondo se gestiona de forma activa sin vinculación a un índice de referencia.
- El Subfondo no promueve características medioambientales o sociales de manera acorde a lo dispuesto en el artículo 8 del Reglamento sobre la divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros («SFDR») ni

tiene como objetivo inversiones sostenibles con arreglo a los criterios específicos previstos en el artículo 9 del SFDR.

- Teniendo en cuenta los objetivos anteriores y el perfil de riesgo y remuneración del producto, el periodo de mantenimiento recomendado es 5 años.

Reembolso y negociación: Este producto se valora cada día en el que los bancos estén abiertos al público en Luxemburgo, en Londres y en Nueva York y en el que los agentes de compensación desempeñen su actividad profesional con normalidad. Las acciones podrán suscribirse o reembolsarse a diario, como muy tarde a las 15:00 horas (hora de Luxemburgo) un Día hábil antes del día de valoración pertinente.

Política de distribución: Este producto no distribuye dividendos. Los ingresos generados por el Subfondo se reinvierten y se incluyen en el valor de su acción.

Inversor al que va dirigido

El Subfondo ha sido diseñado para inversores que buscan el crecimiento del capital a largo plazo a través de la exposición a estrategias de inversión alternativas. Puesto que, por consiguiente, puede que el Subfondo emplee estrategias sofisticadas (incluido el uso de derivados), este está dirigido solamente a inversores experimentados y bien informados con capacidad para comprender y evaluar la estrategia de inversión y sus riesgos inherentes (dicha comprensión y evaluación se podría conseguir gracias al asesoramiento de un asesor profesional). Además, los inversores deben estar capacitados y preparados para invertir en un subfondo con un elevado nivel de riesgo, según se describe con mayor detalle en el capítulo «Tipología de perfiles de riesgo» del folleto. El Subfondo adopta estrategias de inversión sofisticadas que comportan numerosos riesgos, como unos niveles de volatilidad potencialmente elevados. El Subfondo se dirige exclusivamente a los inversores que comprendan estas estrategias y los riesgos conexos. Los inversores potenciales deberían consultar a sus asesores financieros, fiscales y legales, según corresponda, con el fin de determinar la conveniencia de invertir en el Subfondo en función de sus circunstancias individuales.

La clase I5C-U se dirige exclusivamente a inversores institucionales.

La inversión mínima es 150,000,000 USD.

Plazo

Este producto se constituyó con una duración indefinida. El productor podrá rescindirlo unilateralmente. Solo el consejo de administración del Fondo o una junta general de accionistas podrá decidir la rescisión de este producto.

Información práctica

Depositario: RBC Investor Services Bank S.A., 14, Porte de France, L-4360 Esch-sur-Alzette, Gran Ducado de Luxemburgo

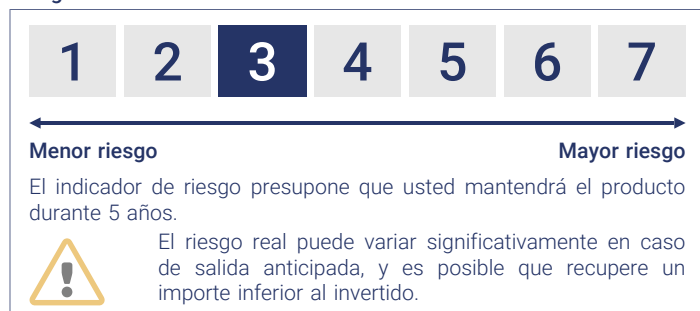
Información adicional: El folleto del Fondo y los informes periódicos se refieren al conjunto del Fondo. Los activos y pasivos de cada subfondo están segregados por ley, lo que significa que los pasivos asignados a un subfondo podrían no afectar a los demás subfondos. Los accionistas tienen derecho a convertir sus acciones por acciones de otro subfondo/ otra clase del fondo, según se describe con mayor detalle en el folleto.

Se pueden obtener, de forma gratuita y en inglés, copias del folleto y de los últimos informes anual y semestral del Fondo en su conjunto, así como otra información práctica como el último precio de las acciones, a través de Alma Capital Investment Management o en www.fundsquare.net.



¿Qué riesgos corro y qué podría obtener a cambio?

Riesgos



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 pueda pagarle.

Este producto ha sido clasificado en la categoría 3 en una escala de 7, lo que significa un riesgo medio bajo.

Esta evaluación califica la posibilidad de sufrir pérdidas en rentabilidades futuras como un nivel medio bajo y la probabilidad de que una mala

Escenarios de rentabilidad

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.

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 del producto durante los últimos 10 años. Los mercados podrían evolucionar de manera muy distinta en el futuro.

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 entre 30 de noviembre de 2015 y 30 de noviembre de 2020.

Moderado: este tipo de escenario se produjo para una inversión entre 25 de abril de 2013 y 25 de abril de 2018.

Favorable: este tipo de escenario se produjo para una inversión entre 30 de septiembre de 2017 y 30 de septiembre de 2022.

| Período de mantenimiento recomendado | | 5 años | |
|--------------------------------------|--|------------------------------------|---|
| Ejemplo de inversión | | \$ 10.000 | |
| Escenarios | | En caso de salida después de 1 año | En caso de salida después de 5 años (período de mantenimiento recomendado) |
| 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. Rendimiento medio cada año | \$ 6.938 -30,6% | \$ 6.397 -8,6% |
| Desfavorable | Lo que podría recibir tras deducir los costes. Rendimiento medio cada año | \$ 7.675 -23,3% | \$ 8.507 -3,2% |
| Moderado | Lo que podría recibir tras deducir los costes. Rendimiento medio cada año | \$ 10.244 2,4% | \$ 10.775 1,5% |
| Favorable | Lo que podría recibir tras deducir los costes. Rendimiento medio cada año | \$ 11.968 19,7% | \$ 12.174 4,0% |

¿Qué pasa si Alma Capital Investment Management S.A. no puede pagar?

Usted está expuesto al riesgo de que Alma Capital Investment Management S.A. no pueda cumplir sus obligaciones con respecto al producto. Esto puede repercutir muy negativamente en el valor del producto, lo que podría conllevar la pérdida de una parte o la totalidad de su inversión en el producto. Las posibles pérdidas no están cubiertas por ningún sistema 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 y de cuánto tiempo mantiene el producto. Los importes indicados aquí ilustran un ejemplo de inversión de una determinada cuantía durante diferentes períodos de inversión posibles. Se basan en los siguientes supuestos reglamentarios: (i) el primer año, recuperaría usted el importe invertido



(rendimiento anual del 0%) y, en relación con los demás periodos de mantenimiento, el producto evoluciona tal como muestra el escenario moderado; y (ii) se invierten \$ 10.000.

| Ejemplo de inversión \$ 10.000 | En caso de salida después de 1 año | En caso de salida después de 5 años (período de mantenimiento recomendado) |
|--|------------------------------------|--|
| Costes totales | \$ 181 | \$ 628 |
| Incidencia anual de los costes* | 1,8% | 1,2% |

(*) 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 2,7% antes de deducir los costes y del 1,5% después de deducir los costes.

Composición de los costes

| Costes únicos de entrada o salida | | Incidencia anual de los costes en caso de salida después de 1 año |
|---|---|---|
| Costes de entrada | 0,00% . En caso de conversión por otra clase u otro subfondo, se aplicará una comisión de conversión máxima del 1%. | \$ 0 |
| Costes de salida | 0,00% . | \$ 0 |
| Costes corrientes detraídos cada año | | |
| Comisiones de gestión y otros costes administrativos o de funcionamiento | 1,15% del valor de su inversión al año. Se trata de una estimación basada en los costes reales del último año. | \$ 115 |
| Costes de operación | 0,02% al año, en promedio de los últimos 3 años, sobre la base del valor de su inversión. 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. | \$ 2 |
| Costes accesorios detraídos en condiciones específicas | | |
| Comisiones de rendimiento | 0,64% del valor de su inversión al año. Esta cifra representa una estimación, calculada cada año, sobre la base de una media de los 5 años anteriores. La comisión de rendimiento ascenderá al 18% de la rentabilidad positiva por encima de la cota máxima («high water mark») o la tasa de corte («hurdle rate»). El importe real variará en función de lo buenos que sean los resultados de su inversión. | \$ 64 |

¿Cuánto tiempo debo mantener la inversión, y puedo retirar dinero de manera anticipada?

Periodo de mantenimiento recomendado: 5 años

El periodo de mantenimiento recomendado se ha definido teniendo en cuenta la anterior política de inversión y el perfil de riesgo y remuneración. Debería estar preparado para mantener su inversión durante al menos 5 años. No obstante, puede reembolsar su inversión sin penalizaciones antes de que concluya el periodo de mantenimiento recomendado o mantener la inversión durante más tiempo. Se puede solicitar el reembolso de acciones todos los días de valoración, siempre y cuando la solicitud de reembolso se reciba como muy tarde a las 15:00 horas (hora de Luxemburgo) un (1) Día hábil antes del día de valoración pertinente, que es cada Día hábil. Las solicitudes que se reciban después de la hora indicada se tendrán en cuenta para el próximo día de valoración y se tramitarán el siguiente día de valoración. La salida antes de que concluya el periodo de mantenimiento recomendado podría tener consecuencias negativas para su inversión.

¿Cómo puedo reclamar?

Si desea presentar una reclamación sobre este producto, siga el procedimiento de presentación de reclamaciones que figura en www.almacapital.com/documentation/. También puede enviar su reclamación al domicilio social de la sociedad gestora y/o directamente a los distribuidores locales y/o a los agentes de pago del país de distribución pertinente o por correo electrónico a la siguiente dirección: compliance@almacapital.com. Si desea presentar una reclamación sobre la persona que le asesoró sobre este producto o que se lo vendió, esta persona le informará sobre cómo hacerlo.

Otros datos de interés

Gestor de inversiones: La Sociedad gestora ha nombrado a State Street Global Advisors Limited como gestor de inversiones del Subfondo y a Winton Capital Management Limited como gestor de carteras.

Escenarios de rentabilidad: Puede consultar los escenarios de rentabilidad anteriores, actualizados cada mes, en <https://alma-capital.priips-scenarios.com/LU1125015336/en/KID/>.

Rentabilidad histórica: Puede descargar la rentabilidad histórica del último/de los últimos 8 año/años de nuestro sitio web: <https://alma-capital.priips-performance-chart.com/LU1125015336/en/KID/>.