

| Documento contenente le informazioni chiave | | | | | | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|--------------------|---|---|---|---|---------------------|--|--|--|--------------------|--|--|
| Scopo | | | | | | | | | | | | | | | |
| Il presente documento contiene informazioni chiave relative a questo prodotto d'investimento (il “Documento”). Non si tratta di un documento promozionale. Le informazioni, prescritte per legge, hanno lo scopo di aiutarvi a capire le caratteristiche, i rischi, i costi, i guadagni e le perdite potenziali di questo prodotto e di aiutarvi a fare un raffronto con altri prodotti d'investimento. | | | | | | | | | | | | | | | |
| Prodotto | | | | | | | | | | | | | | | |
| Alkimis Capital UCITS (il “Fondo”) – Codice ISIN IT0005163743– comune di investimento mobiliare aperto di diritto italiano rientrante nell’ambito di applicazione della Direttiva 2009/65/CE, gestito da Alkimis SGR S.p.A. (la “SGR”), con sede legale in Milano, via dei Bossi n. 4, www.alkimis.it , iscritta al n. 42 all’Albo delle SGR di Banca d’Italia ex art. 35 del TUF – Sezione Gestori di OICVM. È possibile contattare la SGR al numero di telefono 02 30370511 o all’indirizzo e-mail info@alkimis.it . L’autorità responsabile della vigilanza sulla SGR per quanto riguarda il presente Documento è la Consob. Il presente Documento è stato redatto il 22/12/2022. | | | | | | | | | | | | | | | |
| Stare per acquistare un prodotto che non è semplice e può essere di difficile comprensione | | | | | | | | | | | | | | | |
| Cosa è questo prodotto? | | | | | | | | | | | | | | | |
| Tipo: | Il Fondo è un OICVM italiano mobiliare di tipo aperto di diritto italiano, il quale costituisce un patrimonio autonomo, distinto a tutti gli effetti da ogni altro organismo di investimento collettivo del risparmio istituito e/o gestito dalla SGR. Il regolamento del Fondo (il “Regolamento”) prevede l’emissione da tre classi di quote denominate rispettivamente “Accumulazione”, “Coupon” e “I”. | | | | | | | | | | | | | | |
| Obiettivi e attività di investimento: | <p>Il Fondo rientra nella categoria dei fondi Flessibili che mirano ad ottenere rendimenti assoluti positivi attraverso l’incremento del capitale investito in un orizzonte temporale di lungo periodo. A tal fine il Fondo investirà senza vincoli predeterminati in tutte le classi di strumenti finanziari e nello stesso tempo utilizzerà strumenti derivati esclusivamente per finalità di copertura dei rischi connessi con le posizioni assunte o per l’efficiente gestione di portafoglio che non comporti l’esposizione a rischi ulteriori che possano alterare il profilo di rischio - rendimento del Fondo.</p> <p>La politica di gestione prevede l’investimento in azioni e altri titoli rappresentativi di capitale di rischio negoziabili sul mercato dei capitali, in obbligazioni, titoli di stato ed altri titoli di debito negoziabili sul mercato dei capitali, in titoli negoziati sul mercato monetario, in strumenti finanziari del mercato monetario non quotati facilmente liquidabili con vita residua non superiore a 6 mesi, in depositi bancari. Il fondo investe principalmente in strumenti finanziari classificati di “adeguata qualità creditizia” (c.d. investment grade) sulla base del sistema interno di valutazione del merito di credito adottato dalla SGR. Il Fondo non investe in quote di altri OICR. Il portafoglio del Fondo è inoltre investito in maniera anche significativa in strumenti finanziari derivati quotati e non quotati (OTC) (es. Equity Swap, opzioni, ecc.). L’utilizzo degli strumenti finanziari derivati è esclusivamente finalizzato alla copertura dei rischi connessi con le posizioni assunte o per l’efficiente gestione di portafoglio che non comporti l’esposizione a rischi ulteriori che possano alterare il profilo di rischio – rendimento del Fondo. Una parte del patrimonio del Fondo può essere tenuta in disponibilità liquide.</p> <p>In relazione allo stile di gestione adottato (stile flessibile), non è possibile individuare un benchmark rappresentativo della politica di gestione quindi è stato indicato, in alternativa, un indicatore di rischio (VAR) pari a -7% che rappresenta la massima perdita attesa con il 95% di probabilità su un orizzonte temporale di tre anni. Il Fondo è denominato in Euro.</p> | | | | | | | | | | | | | | |
| Modalità di determinazione del rendimento e rapporto tra rendimento e attività di investimento: | La classe di quote denominata “I”, oggetto del presente documento, non distribuisce proventi, che vengono interamente reinvestiti nel Fondo. | | | | | | | | | | | | | | |
| Investitore al dettaglio a cui si intende commercializzare il prodotto: | L’importo minimo della sottoscrizione è pari a 10.000 Euro, ad eccezione delle persone fisiche e giuridiche – non qualificabili come investitori istituzionali – che sottoscrivano la classe “I”, per cui è richiesto un importo minimo della sottoscrizione pari a Euro 1.000.000. È un investitore con almeno una conoscenza ed esperienza di base che gli consenta di comprendere le caratteristiche del Fondo, le strategie d’investimento adottate dalla SGR ed i rischi ad esse connessi. | | | | | | | | | | | | | | |
| Durata: | La durata del Fondo è fissata al 2050 salvo proroga da assumersi con deliberazione del Consiglio di Amministrazione almeno 2 anni prima della scadenza. | | | | | | | | | | | | | | |
| Quali sono i rischi e qual è il potenziale rendimento? | | | | | | | | | | | | | | | |
| Indicatore sintetico di rischio: | | | | | | | | | | | | | | | |
| <table border="1" style="margin: auto; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 20px; text-align: center;">1</td> <td style="width: 20px; text-align: center;">2</td> <td style="width: 20px; text-align: center; color: red;">3</td> <td style="width: 20px; text-align: center;">4</td> <td style="width: 20px; text-align: center;">5</td> <td style="width: 20px; text-align: center;">6</td> <td style="width: 20px; text-align: center;">7</td> </tr> <tr> <td colspan="3" style="text-align: center;">← rischio più basso</td> <td></td> <td colspan="3" style="text-align: center;">rischio più alto →</td> </tr> </table> | | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | ← rischio più basso | | | | rischio più alto → | | |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | | | | | | | | | |
| ← rischio più basso | | | | rischio più alto → | | | | | | | | | | | |
| <p>L’indicatore sintetico di rischio è un’indicazione orientativa del livello di rischio di questo prodotto rispetto ad altri prodotti. Esso esprime la probabilità che il prodotto subisca perdite monetarie a causa di movimenti sul mercato o a causa della nostra capacità di pagarvi quanto dovuto.</p> <p>L’indicatore di rischio presuppone che il prodotto sia mantenuto per 5 anni.</p> <p>Abbiamo classificato questo prodotto al livello 3 su 7, che corrisponde alla classe di rischio medio-bassa.</p> <p>Ciò significa che le perdite potenziali dovute alla performance futura del prodotto sono classificate nel livello medio-basso e che è improbabile che le cattive condizioni di mercato influenzino la capacità di pagarvi quanto dovuto. Il rischio del prodotto può essere significativamente maggiore di quello rappresentato dall’indicatore sintetico di rischio qualora non sia detenuto per il periodo di detenzione raccomandato.</p> | | | | | | | | | | | | | | | |
| Altri rischi, non adeguatamente rilevati dall’Indicatore sintetico, a cui potrebbe essere esposto il Fondo sono: | | | | | | | | | | | | | | | |

- **Rischio di credito:** l'eventualità che un emittente di uno strumento finanziario in cui investe il Fondo non corrisponda allo stesso, alle scadenze previste, tutto o parte del capitale e/o degli interessi maturati.
- **Rischio di liquidità:** l'eventualità che gli strumenti finanziari in cui investe il Fondo non si trasformino prontamente in moneta senza perdita di valore qualora dovessero presentare rischi di credito o di controparte o di mercato.
- **Rischio di controparte** per l'operatività al di fuori dei mercati regolamentati: l'eventualità che la controparte di un'operazione effettuata per conto del Fondo non adempia l'impegno assunto.
- **Rischio connesso all'utilizzo di strumenti derivati:** l'eventualità che la variazione dei prezzi di mercato delle attività sottostanti in cui il Fondo investe abbia un impatto amplificato in termini di guadagno o di perdita sul valore del Fondo (effetto leva).
- **Rischi operativi e rischi legati alla custodia delle attività connessi ad eventi esterni ed a cause di forza maggiore.**

Questo prodotto non comprende alcuna protezione dalla performance futura del mercato; pertanto, potreste perdere il vostro intero investimento o parte di esso.

Scenari di performance:

| Investimento: 10.000 Euro | | Fine 1° anno | 5 anni (Periodo di detenzione raccomandato) |
|-----------------------------|--|--------------|---|
| Scenario di stress | Possibile rimborso al netto dei costi | 7.687 | 6.884 |
| | Rendimento medio per ciascun anno | -23,13% | -7,19% |
| Scenario sfavorevole | Possibile rimborso al netto dei costi | 8.775 | 9.247 |
| | Rendimento medio per ciascun anno | -12,25% | -1,55% |
| Scenario moderato | Possibile rimborso al netto dei costi | 10.236 | 10.802 |
| | Rendimento medio per ciascun anno | 2,36% | 1,56% |
| Scenario favorevole | Possibile rimborso al netto dei costi | 10.994 | 11.968 |
| | Rendimento medio per ciascun anno | 9,94% | 3,66% |

Questa tabella mostra gli importi dei possibili rimborsi nei prossimi 5 anni, periodo di detenzione raccomandato, in scenari diversi, ipotizzando un investimento di 10.000 EUR.

Gli scenari presentati mostrano la possibile performance dell'investimento. Possono essere confrontati con gli scenari di altri prodotti.

Gli scenari presentati sono una stima della performance futura sulla base di prove relative alle variazioni passate del valore di questo investimento e non sono un indicatore esatto. Gli importi dei rimborsi varieranno a seconda della performance del mercato e del periodo di tempo per cui è mantenuto l'investimento/il prodotto.

Lo scenario di stress indica quale potrebbe essere l'importo rimborsato in circostanze di mercato estreme e non tiene conto della situazione in cui non siamo in grado di pagarvi.

Le cifre riportate comprendono tutti i costi del prodotto in quanto tale, ma non comprendono tutti i costi da voi eventualmente pagati al consulente o al distributore. La legislazione fiscale dello Stato Membro di origine dell'investitore al dettaglio può incidere sui versamenti effettivi. Le cifre non tengono conto della vostra situazione fiscale personale, che può incidere anch'essa sull'importo del rimborso.

Cosa accade se Alkimis SGR S.p.A. non è in grado di corrispondere quanto dovuto?

L'investitore può subire una perdita finanziaria derivante dall'insolvenza del fondo/SGR. Non sono previsti sistemi di indennizzo o di garanzia degli investitori in caso di insolvenza della SGR e/o del Fondo.

Quali sono i costi?

Presentazione dei costi

La diminuzione del rendimento (Reduction in Yield — RIY) esprime l'impatto dei costi totali sostenuti sul possibile rendimento dell'investimento. I costi totali tengono conto dei costi una tantum, correnti e accessori.

Gli importi qui riportati corrispondono ai costi cumulativi del prodotto in due periodi di detenzione differenti e comprendono le potenziali penali per uscita anticipata. Questi importi si basano sull'ipotesi che siano investiti 10.000 EUR. Gli importi sono stimati e potrebbero cambiare in futuro.

Andamento dei costi nel tempo

La persona che eventualmente vende o fornisce consulenza riguardo alla vendita potrebbe addebitare altri costi, nel qual caso deve fornire informazioni su tali costi e illustrare l'impatto di tutti i costi sull'investimento nel corso del tempo.

| Investimento: 10.000 Euro | In caso di disinvestimento dopo 1 anno | In caso di disinvestimento dopo 5 anni [periodo di detenzione raccomandato] |
|---------------------------------------|--|---|
| Costi totali | 209 | 1.045 |
| Impatto sul rendimento (RIY) per anno | 2,09% | 2,09% |

Composizione dei costi

La tabella riporta: (i) l'impatto annuale dei diversi tipi di costo sul possibile rendimento dell'investimento alla fine del periodo di detenzione previsto; e (ii) il significato delle differenti categorie di costi.

| Investimento: 10.000 Euro | Euro | Impatto sul rendimento (%) | Significato delle voci |
|---------------------------|--------------------------------------|----------------------------|------------------------|
| Costi una tantum | Costi di ingresso | 0 | 0 |
| | Costi di uscita | 0 | 0 |
| Costi ricorrenti | Costi di transazione del portafoglio | 46 | 0,46% |

| | | | | |
|--------------------------|-----------------------------------|-----|-------|---|
| | Altri costi ricorrenti | 114 | 1,14% | Impatto dei costi che tratteniamo ogni anno per gestire i vostri investimenti e di quelli presentati nella sezione presentazione dei costi. |
| Oneri accessori | Commissioni di <i>performance</i> | 49 | 0,49% | Impatto della commissione di <i>performance</i> . Tratteniamo questa commissione dal vostro investimento esclusivamente se la performance del prodotto supera l'High Water Mark assoluto del Fondo. |
| Costi complessivi | | 209 | 2,09% | |

Per quanto tempo devo detenerlo? Posso ritirare il capitale prematuramente?

Questo prodotto è concepito per investimenti più a lungo termine; l'investitore deve prepararsi a mantenere il suo investimento per almeno 5 anni. Tuttavia, ha diritto al rimborso del suo investimento senza alcuna penale in qualsiasi momento durante questo periodo, oppure può mantenere l'investimento più a lungo. È possibile richiedere il rimborso parziale o totale delle quote del Fondo in qualsiasi giorno lavorativo, senza alcun preavviso. L'importo del rimborso è determinato in base al valore della quota del Fondo del giorno di ricezione della domanda da parte della SGR. Quando nel giorno di ricezione della domanda non è prevista la valorizzazione del Fondo, il valore del rimborso è determinato in base al primo valore della quota del Fondo successivamente determinato. Il valore unitario della quota è determinato settimanalmente dalla SGR.

Come presentare reclami?

Eventuali reclami devono essere trasmessi per iscritto, corredati dalla relativa documentazione di supporto, alla SGR secondo una delle modalità di seguito indicate:

- raccomandata A/R, inviata presso la sede legale della SGR: Via dei Bossi 4, 2021 Milano;
- PEC: alkimis@pec.alkimis.it;
- Email: info@alkimis.it.

In caso si necessiti di informazioni aggiuntive si invita a consultare il sito *internet* <http://www.alkimis.it/index.php>.

Altre informazioni rilevanti

Ulteriori informazioni sono disponibili nel Regolamento, nel Documento Informativo e nel Prospetto consegnati a ciascun investitore al momento della sottoscrizione e, in ogni caso, disponibili presso la sede della SGR.