

Prospecto Simplificado

Este documento contiene la información básica, sobre los atributos y riesgos asociados con el fondo mutuo, que el inversionista debe conocer antes de realizar la suscripción de cuotas. De este modo, la decisión sobre la conveniencia o no de invertir es de su exclusiva responsabilidad.

Fecha de entrada en vigencia: 29 de febrero de 2024

Inscripción en el RPMV: El Fondo fue inscrito el 29 de febrero de 2024, como parte del Programa de Fondos Mutuos BTG Pactual Rendimiento Dólares, en mérito a la Resolución de Intendencia General de Supervisión de Entidades N° 080-2023-SMV/10.2. Es un fondo administrado y gestionado por **BTG Pactual Perú S.A. SAFM.**

Plazo de Vigencia: 365 días calendario contados desde el inicio de etapa operativa.

Objetivo y Política de Inversión.

El Fondo Mutuo inscrito en el marco de este Programa es un fondo mutuo estructurado (en adelante, el Fondo) que tiene como objetivo invertir en un portafolio compuesto predominantemente por instrumentos de deuda y/o depósitos a plazo, y minoritariamente en instrumentos derivados, que en conjunto brindarán un retorno en dólares, que podrán ser adquiridos tanto en el mercado local como en el extranjero.

Para lograr su objetivo, el Fondo aplicará una estrategia que comprende la recuperación de por lo menos el 75% del capital invertido, invirtiendo el capital en instrumentos de deuda hasta un máximo de 100.00% (un mínimo de 98%) de los fondos administrados con el fin de generar un rendimiento atractivo para los inversionistas. Estas inversiones podrán realizarse en dólares y/o en soles. Todos los instrumentos serán mantenidos hasta el vencimiento del Fondo. Los instrumentos de deuda que contempla el Fondo incluyen bonos, certificados de depósito y/o depósitos a plazo tanto en el mercado local como extranjero.

Las inversiones en instrumentos de deuda en mercado local no podrán tener clasificación de riesgo local menor a A en el caso de una entidad financiera, CP-2 en el caso de instrumentos de corto plazo y A- en el caso de bonos. Las inversiones en el exterior no podrán tener clasificación de riesgo internacional menor a CP-5 en el caso de instrumentos de corto plazo y/o BB- en el caso de instrumentos de largo plazo.

Las inversiones en instrumentos derivados podrán realizarse en forwards y/o en opciones. En el caso de forwards, estos tendrán fines de cobertura a la moneda del valor cuota del fondo (dólares americanos) sobre el instrumento de deuda que el

fondo haya adquirido que esta denominado en Soles ("Inversiones en sintéticos"¹). Los derivados sin fines de cobertura serán opciones financieras sobre un activo financiero subyacente que pueden ser adquiridas de manera individual o empaquetadas (a través de una Nota Estructurada o Warrants) que ofrecerán un rendimiento adicional al Fondo en caso se cumplan ciertas condiciones inherentes a la estructura pactada desde el inicio de la etapa operativa. El costo de estos derivados no deberá de ser superior al 2% de los fondos administrados, teniendo como activo subyacente a acciones, monedas, índices o ETFs que sean líquidos y de conocimiento general para los inversionistas.

Si bien la política de inversión busca recuperar por lo menos el 75% del capital invertido, el fondo no cuenta con garantía de terceros.

La duración del Fondo será de trescientos sesenta y cinco (365) días contados desde el inicio de etapa operativa, asimismo, la fecha de vencimiento de los instrumentos de deuda y derivados se encontrará dentro de los 30 días anteriores a la fecha de vencimiento del Fondo. El Fondo tendrá una fecha certera de vencimiento, que se contará desde el día de inicio de entrada en etapa operativa. Al llegar a esta fecha de vencimiento, el Fondo se liquidará a través de un rescate automático que será pagado al día hábil siguiente a los partícipes.

La estructura del Fondo final será comunicada al partícipe mediante carta remitida a través del medio establecido en el Contrato de Administración dentro de un plazo que no excederá los tres (3) días útiles contados a partir del día de inicio de la etapa operativa. Incluirá el detalle de los activos que conforman el portafolio, la rentabilidad mínima esperada, la rentabilidad potencial generada por los derivados (incluyendo el activo subyacente

¹ Se entiende por "Inversiones en Sintéticos" a inversiones en instrumentos de deuda denominada en monedas distintas del valor cuota y a la par en Forwards Venta a la moneda del fondo y con el mismo vencimiento de las inversiones en instrumentos de deudas y con un tipo de cambio pactado a vencimiento. De

esta manera, al vencimiento del fondo no habrá efecto por diferencias de tipo de cambio y se podrá conocer la rentabilidad implícita de la estructura en la moneda del fondo.

seleccionado) y la casuística para que esta se materialice, y la fecha de vencimiento del Fondo.

El valor cuota del Fondo esta denominado en dólares americanos.

El indicador de comparación de los rendimientos del fondo (benchmark) está conformado por el promedio simple de las tasas de los depósitos a plazo en dólares de los tres principales bancos del sistema bancario, medidos por el tamaño de los pasivos según lo publicado a fin de mes en la página web de la Superintendencia de Banca y Seguros: <https://www.sbs.gob.pe/app/pp/EstadisticasSAEEP/ortal/Paginas/TIPasivaDepositoEmpresa.aspx?tip=B>, con el mismo plazo de vencimiento del Fondo al inicio de su etapa operativa.

$$\text{Benchmark} = (\text{Banco}_1 + \text{Banco}_2 + \text{Banco}_3) / 3$$

La comparación entre el desempeño de El Fondo y el indicador de comparación mencionado será informada al partícipe en su estado de cuenta de acuerdo con lo establecido en el Reglamento de Fondos Mutuos de Inversión en Valores y sus Sociedades Administradoras.

Recomendación: Este Fondo no es adecuado para inversionistas que prevean retirar su dinero antes de finalizado el plazo de vencimiento del Fondo.

Procedimiento de Suscripción y Rescate

- a) Modalidad de aporte permitida: Solo se permiten aportes dinerarios vía transferencia bancaria.
- b) Suscripción mínima inicial: Cinco mil dólares americanos (US\$ 5,000) para personas naturales y jurídicas.
- c) Monto mínimo de posteriores suscripciones y rescates: Durante etapa pre- operativa, Mil dólares americanos (US\$ 1,000.00) para personas naturales y jurídicas. Si el rescate se realiza en cuotas, el monto mínimo se calculará tomando en cuenta el valor cuota que figure en el sistema al momento de realizar la operación, salvo que se trate de rescates totales.

Una vez iniciada la etapa operativa del Fondo, no se permitirán hacer rescates, suscripciones o transferencias, dada la naturaleza misma de un fondo estructurado.

Al alcanzar la fecha de vencimiento del Fondo, se hará un rescate total automático a todos los inversionistas, que se liquidará y abonará el día siguiente hábil de esta fecha (t+1) a la cuenta de los partícipes del Fondo.

- d) Saldo mínimo de permanencia: Cinco mil dólares americanos (US\$ 5,000.00), tanto para personas naturales como jurídicas, salvo que

dicho saldo se vea reducido por variaciones en el valor cuota.

El saldo mínimo se calculará tomando en cuenta el valor cuota que figure en el sistema al momento de realizar una operación de rescate, sin considerar las suscripciones del día. Si al realizar el cálculo, el cliente no llega a cubrir el saldo mínimo establecido, la solicitud de rescate será rechazada.

- e) Plazo mínimo de permanencia: trescientos sesenta y cinco (365) días calendario contados desde el inicio de la etapa operativa del Fondo. El inicio de la etapa operativa del Fondo será reportado como hecho de importancia en la página web de la SMV.

Adicionalmente, será comunicado a los partícipes a través de la dirección, física o electrónica, con un plazo no mayor a los tres (3) días hábiles contados desde el inicio de etapa operativa, la fecha de vencimiento del Fondo, así como detalles de las inversiones mantenidas.

- f) Método de asignación del valor cuota: Las Cuotas se valorizan todos los días calendario. Los aportes por suscripción y las solicitudes de rescate que se produzcan desde la hora de corte del día anterior ("t-1") hasta la hora de corte del día actual ("t"), se les asignará el valor cuota del día actual ("t"). Solo se aceptarán estas operaciones en días hábiles, en caso de días de fines de semana o feriados, se considerarán como realizadas al día hábil siguiente ("t+1").

En el caso de solicitudes de traspaso, el valor cuota asignado a las operaciones de rescate y suscripción a los fondos definidos por el cliente, dependerá del Anexo de Participación del fondo correspondiente.

- g) Medios y hora de atención: Las solicitudes de suscripción y rescate podrán presentarse de lunes a viernes entre las 9:00 horas a 17:00 horas en las oficinas de la administradora y/o a través de los medios electrónicos permitidos por la Administradora². En caso se presenten posterior a esta hora o en día no hábil se considerarán como del día siguiente hábil más cercano. Adicionalmente, en el caso de las suscripciones, se deberá acreditar la disponibilidad de los fondos en la cuenta corriente del Fondo para procesarla.

Las solicitudes de traspaso también podrán ser presentadas por los medios descritos, asignándose el valor cuota conforme lo establecido en el literal f) precedente.

Perfil de riesgo del fondo

Los riesgos a los que se encuentra expuesto el fondo mutuo son los siguientes:

² BTG Pactual cuenta con el sistema de firma electrónica provisto por DocuSign, con lo cual se busca facilitar la firma

de documentos con nuestros clientes. Mayor detalle revisar el Anexo del Reglamento de Participación de este fondo.

- | | |
|---|---|
| ☒ Liquidez | ☒ Sectorial |
| ☒ Concentración | ☒ Contraparte |
| ☒ Tasa de Interés | ☒ Riesgo Tributario |
| ☒ País | ☒ Emisor (crédito) |

La explicación de los riesgos del Fondo marcados se encuentra detallada en el Anexo del Reglamento de Participación de este fondo.

Comisiones y gastos del Fondo

Gastos a cargo del inversionista:	%
i) Comisión de Suscripción	0
ii) Comisión de Rescate	0
iii) Comisión de Transferencia	0
iv) Comisión de Traspaso	0

Gastos a cargo del Fondo:	%
i) Comisión Unificada del Fondo:	0.40% nominal anual (base 360 días) más IGV.
ii) Comisiones propias de las operaciones de inversión:	Mercado local y extranjero hasta 5% del monto negociado (incluye los impuestos de ley de cada mercado).
iii) Tributos cobrados por la SMV:	0.0021% mensual aproximadamente

Información Adicional

- Custodia: Scotiabank Peru S.A.A.
- Agente colocador: El proceso de colocación se realizará a través de los promotores directos contratados por la administradora y/o BTG Pactual Perú S.A. SAB.
- Infórmese más sobre las características del fondo en el Reglamento de Participación y el respectivo anexo del Reglamento de Participación, así como de los reportes periódicos, a los cuales puede acceder de forma gratuita en nuestra web: **www.btgpactual.com.pe**. Los valores cuota de los fondos se encuentran en la página web la Superintendencia del Mercado de Valores (www.smv.gob.pe).

- Ejemplo de escenarios que reflejan el resultado que se obtendría con la estrategia de opciones utilizada.
 - Subyacente: Cotización sobre el Euro (EUR/USD).
 - Estrategia de opciones: Rango digital entre 1.0950 – 1.1150.
 - Escenario positivo: A la fecha de vencimiento, la cotización del EUR/USD cae dentro del rango establecido, entonces se recibe un rendimiento adicional de 1.0%
 - Escenario negativo: A la fecha de vencimiento, la cotización del EUR/USD cae fuera del rango establecido (por debajo de 1.0950 o por encima de 1.1150), entonces no se recibe rendimiento adicional.
 - Fecha de observación: Un día hábil antes de la fecha de vencimiento del fondo.
 - Fecha de pago: El costo de la prima a pagar por las opciones será pagado el día de inicio de etapa operativa del fondo; mientras que la fecha de pago del rendimiento adicional en caso sea un escenario positivo se pagará en la fecha de vencimiento del fondo.