Documento de datos fundamentales

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.

Global X S&P 500® Annual Buffer UCITS ETF
un subfondo de **Global X ETFs ICAV**
Clase de acciones de acumulación USD (IE0009BM62P2)

Productor: Global X Management Company (Europe) Limited, parte del grupo de empresas Global X.

El Banco Central de Irlanda es responsable de la supervisión de Global X Management Company (Europe) Limited en relación con este documento de datos fundamentales.
Este PRIIP está autorizado en Irlanda.
Global X Management Company (Europe) Limited está autorizada en Irlanda y regulada por el Banco Central de Irlanda.
Para obtener más información sobre este producto, visite www.globalxetfs.eu, envíe un correo electrónico a europe@globalxetfs.com o llame al: +44 (0)20 4529 2551.

Este documento se elaboró el 15 de diciembre de 2025.

¿Qué es este producto?

Tipo:
Este producto es un fondo OICVM.
Plazo:
Este es un Fondo abierto.
Objetivos:
El objetivo de inversión del Fondo consiste en obtener resultados que, antes de descontar comisiones y gastos, se correspondan en gran medida con el comportamiento de los precios y el rendimiento del CBOE S&P 500® Annual 15% Buffer Protect Index (el «**Índice**»). El Índice trata de obtener una rentabilidad similar a la del S&P 500® Index (el «**Índice de referencia**»), con menos volatilidad y riesgos de pérdidas en la mayoría de los contextos de mercado, salvo cuando el mercado de renta variable estadounidense experimente subidas.
El Fondo se gestiona de forma pasiva. El Fondo tratará de replicar la rentabilidad del Índice principalmente mediante la inversión en una cesta de valores de renta variable y relacionados con renta variable de todo el mundo (la «**Cesta**») y celebrará un acuerdo de *unfunded swap* con contrapartes autorizadas que se rigen por la Swaps and Derivatives Association, a fin de canjear la rentabilidad/rendimiento de la Cesta por el rendimiento del Índice menos cualesquiera comisiones asociadas (el «**Swap**»).
El Índice ha sido diseñado para replicar la rentabilidad de una inversión en el Índice de referencia mediante una cartera de valores de renta variable durante un período aproximado de un año (el «**período de inversión**»), al tiempo que trata de proporcionar protección a la baja frente a descensos del valor del 15% (el «**buffer**») del Índice de referencia.
El buffer que proporciona el Índice se elabora mediante un put spread por el que el Índice adquiere una opción de venta (*put*) en el Índice de referencia a un precio de ejercicio (en dinero) y vende una opción de venta en el Índice de referencia a un menor precio de ejercicio (15% fuera de dinero). El put spread pretende proporcionar protección ante un descenso del Índice de referencia, aunque únicamente de la medida de la diferencia entre los precios de ejercicio de la opción de venta adquirida y la opción de venta vendida. Por estas opciones se abonará un coste: la prima. La prima abonada por la opción de venta adquirida será mayor que la prima percibida por la opción de venta vendida.
Con miras a cubrir el coste del put spread que facilita el colchón, el Índice vende —o suscribe— una opción de compra (*call*) en el Índice de referencia a cambio de percibir una prima del Índice que se corresponde con el coste del put spread. Si bien la suscripción de opciones de compra reduce el coste de la dotación del buffer, funciona limitando la participación del Índice en el aumento de valor del Índice de referencia por encima del precio de ejercicio de la opción de compra suscrita, que actúa como cap (límite) sobre el incremento potencial del valor del Índice.
Los inversores que posean acciones del Fondo al comienzo del período de inversión y las mantengan hasta el final de este serán los únicos que podrán realizar los niveles completos del buffer y el cap. Los inversores que adquieran acciones una vez iniciado el período de inversión o que las vendan antes de que concluya podrán obtener una rentabilidad de la inversión muy distinta de la que pretende ofrecer el Fondo, ya que su valor liquidativo cambia durante el período con respecto al buffer y el cap estáticos.
En caso de que no sea posible o viable que el Fondo invierta en *swaps*, este también podrá obtener exposición al Índice mediante la inversión en otros derivados, como opciones y futuros, mediante la inversión en participaciones u otros organismos de inversión colectiva o mediante la inversión en una cartera de valores de renta variable que, en la medida de lo posible y lo viable, esté formada por los valores que componen el Índice.
La moneda de base del Fondo es el USD.
En el caso de las Acciones de acumulación, los ingresos se reinvertirán automáticamente en el Fondo y se reflejarán en el Valor liquidativo de la acción.

Los inversores pueden comprar y vender acciones del Fondo en cualquier día hábil. Por día hábil se entiende un día en el que las Bolsas de Nueva York y de Londres abran para el desarrollo de su actividad normal.

Para obtener más información sobre la política de inversión y la estrategia del Fondo, remítase a las secciones tituladas «Investment Objective» e «Investment Policy» del suplemento del Fondo. Los documentos del Fondo, incluyendo el Folleto, el Suplemento y los informes anual y semestral más recientes se pueden obtener gratuitamente en inglés. Estos se pueden encontrar, junto con otra información, como los precios y las clases de acciones, en el sitio web del Fondo, en www.globalxetfs.eu.

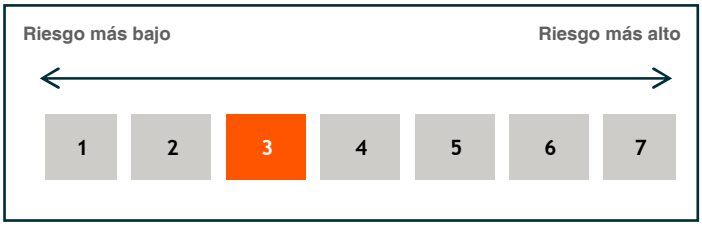
El depositario es SEI Investments - Depositary and Custodial Services (Ireland) Limited.

Este documento describe un subfondo del OICVM. El Folleto y los informes periódicos se refieren al conjunto del OICVM. El activo y el pasivo de cada subfondo del OICVM están segregados por ley, por lo que el activo de un subfondo no puede destinarse a atender el pasivo de otro subfondo.

Inversor minorista al que va dirigido:
Este Fondo va dirigido a inversores que están familiarizados con las estrategias de buffer o garantía y de cap o límite con protección frente a caídas y que desean adoptar una exposición a largo o corto plazo en el mercado cubierta por el Índice, que estén dispuestos a aceptar los riesgos medios asociados con una inversión de este tipo, incluida la volatilidad potencial de este mercado. Dicho inversor debe ser también capaz de valorar las ventajas y los riesgos de una inversión en las Acciones de la Clase pertinente del Fondo.

¿Qué riesgos corro y qué podría obtener a cambio?

Indicador de riesgo



El indicador de riesgo presupone que usted mantendrá el producto durante 5 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 3 en una escala de 7, en la que 3 significa un riesgo medio bajo. Esta evaluación califica la posibilidad de sufrir pérdidas en rentabilidades futuras como media baja y la probabilidad de que una mala coyuntura de mercado influya en su capacidad de obtener un rendimiento de la inversión positivo como improbable.

Tenga presente el riesgo de cambio. Recibirá pagos en una moneda diferente, por lo que su rentabilidad final dependerá del tipo de cambio entre las dos monedas. Este riesgo no se tiene en cuenta en el indicador indicado anteriormente.
Este producto no incluye protección alguna respecto de la rentabilidad futura del mercado, por lo que podría perder parte o la totalidad de su inversión. Si no podemos pagarle las sumas adeudadas, usted podría perder la totalidad de su inversión.
Para más información sobre otros riesgos de importancia significativa para el producto que podría no reflejar adecuadamente el indicador resumido de riesgo, consulte el Folleto y el Suplemento disponibles en www.globalxetfs.eu.

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 / e incluyen los costes de su asesor o distribuidor. Las cifras no tienen en cuenta su situación fiscal personal, que también puede influir en la cantidad que reciba.

Los escenarios desfavorable, moderado y favorable que se muestran son ilustraciones basadas en la rentabilidad más baja, media y más alta del Global X S&P 500® Annual Buffer UCITS ETF durante los últimos 10 años.

El escenario de tensión muestra lo que usted podría recibir en circunstancias extremas de los mercados. Los mercados podrían evolucionar de manera muy distinta en el futuro.

Lo que obtenga de este producto dependerá de la evolución futura del mercado, la cual no puede predecirse con exactitud. Los escenarios mostrados son solo indicativos de algunos resultados posibles basados en rendimientos recientes. Los rendimientos reales podrían ser inferiores.

Período de mantenimiento recomendado:
5 años

Inversión: 10.000 USD

Escenarios **Mínimo: No hay un rendimiento mínimo garantizado en caso de salida antes de 5 años**		**En caso de salida después de 1 año**	**En caso de salida después de 5 años (período de mantenimiento recomendado)**
Tensión	**Lo que podría recibir tras deducir los costes** Rendimiento medio cada año	4.850 USD -51,49%	4.850 USD -13,48%
Desfavorable[1]	**Lo que podría recibir tras deducir los costes** Rendimiento medio cada año	9.460 USD -5,38%	11.230 USD 2,35%
Moderado[2]	**Lo que podría recibir tras deducir los costes** Rendimiento medio cada año	10.680 USD 6,82%	13.080 USD 5,51%
Favorable[3]	**Lo que podría recibir tras deducir los costes** Rendimiento medio cada año	12.500 USD 24,99%	16.050 USD 9,92%

[1] Este tipo de escenario se produjo para una inversión entre octubre 2024 y octubre 2025.
[2] Este tipo de escenario se produjo para una inversión entre marzo 2016 y marzo 2021.
[3] Este tipo de escenario se produjo para una inversión entre octubre 2020 y octubre 2025.

¿Qué pasa si Global X Management Company (Europe) Limited, parte del grupo de empresas Global X no puede pagar?

Usted puede enfrentarse a pérdidas financieras en caso de impago del productor o el depositario, SEI Investments – Depositary and Custodial Services (Ireland) Limited.

No existe ningún régimen de compensación o garantía que pueda compensar dichas pérdidas ni en parte ni en su totalidad.

¿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 detraen 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 usted el importe invertido (rendimiento anual del 0%). En relación con los demás períodos de mantenimiento, hemos supuesto que el Fondo evoluciona tal como muestra el escenario moderado y que se invierten 10.000 USD.

Inversión: 10.000 USD	**En caso de salida después de 1 año**	**En caso de salida después de 5 años**
Costes totales	51 USD	319 USD
Incidencia anual de los costes (*)	0,5%	0,5%

(*) 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 6,0% antes de deducir los costes y del 5,5% después de deducir los costes.

Composición de los costes

Costes únicos de entrada o salida		En caso de salida después de 1 año
Costes de entrada	Ninguno * * Puede que los inversores del mercado secundario (aquellos que operan en una bolsa de valores) abonen las comisiones aplicadas por sus brókeres. Estos gastos, si los hubiese, pueden consultarse a los brókeres. Los participantes autorizados que realicen operaciones directamente con el Fondo abonarán los costes de operación asociados a sus suscripciones y reembolsos.	0 USD
Costes de salida	Ninguno * * Puede que los inversores del mercado secundario (aquellos que operan en una bolsa de valores) abonen las comisiones aplicadas por sus brókeres. Estos gastos, si los hubiese, pueden consultarse a los brókeres. Los participantes autorizados que realicen operaciones directamente con el Fondo abonarán los costes de operación asociados a sus suscripciones y reembolsos.	0 USD
Costes corrientes detraídos cada año		**En caso de salida después de 1 año**
Comisiones de gestión y otros costes administrativos o de funcionamiento	0,5% 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. La comisión de gestión anual de este producto es del 0,5%.	50 USD
Costes de operación	0,0% 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.	1 USD
Costes accesorios detraídos en condiciones específicas		**En caso de salida después de 1 año**
Comisiones de rendimiento	Este producto no tiene comisiones de rendimiento.	0 USD

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

Período de mantenimiento recomendado: 5 años

Este producto no tiene ningún período de mantenimiento mínimo exigido, pero ha sido diseñado para la inversión a largo plazo; usted debería estar dispuesto a mantener su inversión durante al menos 5 años. Los 5 años se han calculado para que sean acordes con el período de tiempo que puede necesitar el Producto para lograr sus objetivos de inversión. Usted puede vender sus acciones del producto, sin ninguna penalización, en cualquier día en el que los bancos abran para el desarrollo de su actividad habitual en Irlanda y en que la Bolsa de Nueva York y la Bolsa de Londres abran para el desarrollo de su actividad habitual.

El valor de su inversión puede subir o bajar con independencia del tiempo durante el que mantenga sus inversiones, en función de factores como la rentabilidad del Fondo, las variaciones de los precios de las acciones y los bonos y las condiciones generales de los mercados financieros. Para obtener información sobre los costes y los gastos relativos a la venta de acciones, contacte con su intermediario bursátil, asesor financiero o distribuidor.

¿Cómo puedo reclamar?

Si desea presentar alguna reclamación sobre el producto o el comportamiento del productor o de la persona que asesore sobre el mismo, puede utilizar gratuitamente los siguientes métodos:

i. Teléfono: +44 (0)20 4529 2551

ii. Correo electrónico: complaints@globalxetfs.com

iii. Correo postal: 10 Earlsfort Terrace, Dublin 2, Irlanda

iv. En línea: www.globalxetfs.eu/

También tiene derecho a remitir la reclamación pertinente al Defensor de los Servicios Financieros y Pensiones tras haber completado el proceso de reclamación del Fondo si no está satisfecho con la respuesta recibida. Puede encontrar información adicional sobre la política de reclamaciones del fondo en www.globalxetfs.eu.

Otros datos de interés

Estamos obligados a poner a disposición documentación adicional, como, por ejemplo, el folleto más reciente, la información sobre la rentabilidad histórica y el último informe anual y semestral. Estos documentos y otra información sobre los productos se encuentran disponibles en https://globalxetfs.eu/priips-performance/.

Para consultar la rentabilidad histórica y los escenarios anteriores del fondo, visite: www.globalxetfs.eu. Se dispone de datos de rentabilidad histórica correspondiente a un máximo de 10 años.