

INFORMATIONS CLÉS POUR L'INVESTISSEUR

Ce document fournit des informations essentielles aux investisseurs de ce Fonds. Il n'a aucune vocation de marketing. Les informations qu'il contient vous sont fournies conformément à une obligation légale, afin de vous aider à comprendre en quoi consiste un investissement dans ce Fonds et quels risques y sont associés. Il vous est conseillé de le lire afin que vous puissiez prendre une décision éclairée sur votre investissement.

Systematica Liquid Multi Strategy Fund (le « Fonds »), un compartiment de Systematica UCITS Fund ICAV (l'« ICAV ») L'ICAV est gérée par Carne Global Fund Managers (Ireland) Limited (le « Gestionnaire ») Actions de capitalisation de Catégorie F EUR (ISIN : IE00082IMN35)

Objectifs et politique d'investissement

Le Fonds a pour objectif une appréciation à long terme de son capital. Le Fonds vise à atteindre cet objectif essentiellement en investissant à l'échelle mondiale dans des actions, des devises, des bons du Trésor américain et des instruments financiers dérivés (« IFD ») figurant dans la rubrique « Objectifs et politique d'investissement » du supplément du Fonds (le « Supplément ») au Prospectus de l'ICAV (le « Prospectus ») sélectionnés par les sous-gestionnaires de portefeuille sur la base de modèles de négociation informatiques et de formules mathématiques.

Les modèles de négociation visent à concevoir un portefeuille d'investissement comprenant une série de Primes de risque neutre par rapport au marché des actions et de Primes de risque macroéconomique et à suivre une gamme de stratégies pouvant être réparties en cinq groupes : Value, Momentum, Carry, Volatilité et Defensive, tel que décrit plus en détail dans le Supplément.

Les opportunités d'investissement identifiées par les modèles de négociation sont exploitées en adoptant des positions longues synthétiques ou physiques ou des positions courtes synthétiques en actions, IFD, devises et bons du Trésor américain identifiés par les modèles de négociation. Les sous-gestionnaires de portefeuille cherchent à réduire les risques associés à ces types de positions en investissant dans un portefeuille diversifié d'environ 2 500 instruments.

Le Fonds peut investir dans des espèces et équivalents de trésorerie de façon à disposer de suffisamment de liquidités et d'actifs liquides pour répondre aux demandes de rachat et aux appels de marge. Le Fonds peut investir jusqu'à 10 % de sa VNI dans d'autres organismes de placement collectif sélectionnés par les sous-gestionnaires de portefeuille. Le Fonds peut investir plus de 20 % de son actif net dans des titres domiciliés ou négociés dans certains pays émergents.

L'ICAV considère que le Fonds remplit les critères de l'article 8 du Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (Règlement UE/2019/2088) pour être considéré comme un produit financier qui promeut, entre autres caractéristiques, des caractéristiques environnementales ou sociales. Vous trouverez de plus amples informations sur les facteurs de durabilité de ce produit dans le Prospectus.

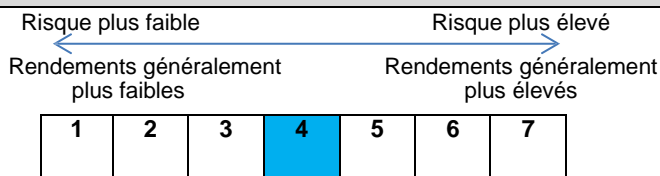
Vous pouvez acheter et vendre vos actions lors de tout jour ouvrable. Les ordres d'achat ou de vente peuvent être passés par transmission à l'agent administratif d'une demande à cet effet au plus tard à midi (heure irlandaise), le jour ouvrable précédant directement le Jour de négociation concerné. Le paiement pour les ordres d'achat doit être reçu au plus tard à 17 h (heure irlandaise), trois jours ouvrables après le Jour de Négociation concerné. Les demandes reçues après cette heure seront différées jusqu'au prochain Jour de Négociation.

Le Fonds est géré activement, ce qui signifie qu'il ne suit pas un indice, bien que les investissements du Fonds ne soient pas choisis spécifiquement à la discrétion du gestionnaire de portefeuille ou des sous-gestionnaires de portefeuille, mais principalement à l'aide de modèles informatiques qui sélectionnent les investissements sur la base d'algorithmes mathématiques.

Vos Actions de capitalisation de catégorie A GBP ne donnent pas de dividendes. Un placement dans le Fonds convient pour des investisseurs disposés à accepter des risques moyens à élevés et prévoyant de conserver leur position sur une durée moyenne à longue. La devise de référence du Fonds est le dollar US. Le Fonds cherche à se prémunir des fluctuations des cours de change en investissant dans d'autres devises.

Pour prendre connaissance de l'intégralité des objectifs et des politiques d'investissement, se reporter à la rubrique du Supplément portant sur les objectifs et politiques d'investissement.

Profil de risque et de rendement



Pourquoi le Fonds relève-t-il de cette Catégorie ?

Cet indicateur se fonde sur des données historiques et ne donne pas nécessairement une idée fiable du futur profil de risque du Fonds. Rien ne garantit que la catégorie de risque indiquée reste inchangée : elle peut évoluer dans le temps. Même la catégorie la plus basse (la catégorie 1) ne représente pas un placement sans risque. Le Fonds est de catégorie 4 en raison du degré de volatilité qu'il affiche.

L'indicateur de risques et de rendement ne rend pas nécessairement compte des risques suivants :

- Risques liés à des modèles de négociation systématique ;
- Risque lié aux marchés boursiers ;
- Risque de crédit ;
- Risque lié aux produits dérivés ;
- Risque de change ;
- Risque lié aux marchés émergents ;
- Risques liés à des marchés hautement volatils ;
- Risque de contrepartie ;
- Risques de dépôt ; et
- Risque de liquidité.

Une description détaillée des facteurs de risque, dont les précédents, figure à la rubrique intitulée « Risques d'investissement » du Prospectus et du Supplément.

Frais																	
Les frais que vous acquittez servent à couvrir les charges d'exploitation du Fonds, dont les coûts de commercialisation et de distribution. Ces frais réduisent la croissance potentielle de votre investissement.																	
<table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td colspan="2">Frais ponctuels prélevés avant ou après investissement</td> </tr> <tr> <td style="width: 30%;">Frais d'entrée</td> <td>Aucuns</td> </tr> <tr> <td>Frais de sortie</td> <td>Aucuns</td> </tr> <tr> <td>Commissions de conversion</td> <td>Maximum 1 % des produits du rachat</td> </tr> <tr> <td colspan="2">Frais prélevés sur le Fonds sur une année</td> </tr> <tr> <td>Frais courants</td> <td>0,69 %</td> </tr> <tr> <td colspan="2">Frais prélevés par le fonds dans certaines circonstances</td> </tr> <tr> <td>Commission de performance</td> <td>10 %</td> </tr> </table> <p>Le montant des frais courants se fonde sur les frais de l'exercice clos le 31 décembre 2024. Ce chiffre peut varier d'une année à l'autre. Pour chaque exercice, le rapport annuel du Fonds donnera le montant exact des frais encourus.</p> <p>Les frais courants excluent les coûts de transaction du portefeuille, sauf dans le cas de frais d'entrée/sortie payés par le Fonds lors de l'achat ou de la vente de parts dans un autre organisme de placement collectif.</p>	Frais ponctuels prélevés avant ou après investissement		Frais d'entrée	Aucuns	Frais de sortie	Aucuns	Commissions de conversion	Maximum 1 % des produits du rachat	Frais prélevés sur le Fonds sur une année		Frais courants	0,69 %	Frais prélevés par le fonds dans certaines circonstances		Commission de performance	10 %	<p>Les Administrateurs peuvent avoir recours à l'« anti-dilution levy » et imposer des commissions de rachats compensatrices dans le cas de rachats nets sur une base transactionnelle, sous la forme d'un ajustement en pourcentage de la valeur du rachat en question afin de refléter l'impact des autres coûts de transaction et de préserver la valeur des actifs sous-jacents.</p> <p>Les frais courants réels peuvent varier et rien ne garantit qu'ils correspondront au niveau réel des frais courants engagés par le Fonds. Pour plus d'informations sur les frais, veuillez consulter la rubrique intitulée « Frais et dépenses » du Prospectus et du Supplément.</p>
Frais ponctuels prélevés avant ou après investissement																	
Frais d'entrée	Aucuns																
Frais de sortie	Aucuns																
Commissions de conversion	Maximum 1 % des produits du rachat																
Frais prélevés sur le Fonds sur une année																	
Frais courants	0,69 %																
Frais prélevés par le fonds dans certaines circonstances																	
Commission de performance	10 %																
Performances passées																	
<p>Le Fonds a été autorisé par la Banque centrale d'Irlande le 3 novembre 2017. Comme la catégorie d'actions n'a pas encore été lancée, les données sont insuffisantes pour fournir aux investisseurs une indication utile des performances passées. Le Fonds n'est pas géré par rapport à un indice de référence.</p>																	
Informations pratiques																	
<ul style="list-style-type: none"> • L'actif de l'ICAV est aux mains de son dépositaire, the Bank of New York Mellon SA/NV. • Des informations complémentaires en langue anglaise sur le Fonds (dont le Prospectus et les derniers états financiers) et ses différentes catégories d'actions sont disponibles gratuitement au siège social de l'ICAV, 3rd Floor 55 Charlemont Place Dublin 2, Irlande, D02 F985, pendant les jours ouvrables, aux heures d'ouverture normales. On peut consulter la valeur nette d'inventaire par action du Fonds à l'adresse http://ucits.systematica.com. La politique de rémunération du Gestionnaire est disponible sur http://www.carnegroup.com/policies et un exemplaire papier est mis à la disposition des investisseurs gratuitement sur demande. • Le Fonds est assujéti au droit fiscal irlandais, ce qui peut avoir des conséquences fiscales négatives pour l'investisseur. L'investisseur est invité à consulter son conseiller fiscal avant d'investir dans le Fonds. • La responsabilité du Gestionnaire ne peut être engagée que sur la base de déclarations figurant dans le présent document trompeuses, inexactes ou non cohérentes avec les parties correspondantes du Prospectus de l'ICAV. • L'ICAV est une société à compartiments multiples appliquant le principe de la séparation des engagements entre compartiments. Ce qui signifie que, en vertu de la législation irlandaise, les participations du Fonds sont séparées de celle des autres compartiments de l'ICAV et que votre investissement dans le Fonds ne sera pas affecté par des réclamations à l'encontre de tout autre compartiment de l'ICAV. • L'investisseur est en droit de convertir sa position d'une catégorie d'actions de l'ICAV à une autre et d'un compartiment de l'ICAV à un autre. Pour plus d'informations, veuillez consulter le Prospectus et le Supplément. • Les Actions de capitalisation de catégorie F EUR ont été choisies en tant que catégorie représentative de toutes les catégories d'actions de distribution et de capitalisation GBP, EUR, USD, CHF, AUD, JPY, SGD, HKD, DKK, SEK et NOK de catégorie F du Fonds. Pour plus d'informations sur les autres catégories d'actions du Fonds, veuillez consulter le Supplément. <p>L'ICAV et le Gestionnaire sont agréés et régulés par la Banque centrale d'Irlande.</p> <p>Les informations clés destinées aux investisseurs reprises dans le présent document sont réputées exactes en date du 19 février 2025.</p>																	