

INFORMATIONS CLÉS POUR L'INVESTISSEUR

Ce document fournit des informations essentielles aux investisseurs de ce Fonds. Il ne s'agit pas d'un document promotionnel. 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 pour décider en connaissance de cause d'investir ou non.

BlueMatrix Fund (le « Fonds ») un compartiment de Systematica UCITS Fund ICAV (l'« ICAV ») Actions de non-distribution de catégorie A USD (ISIN : IE00BYND0702)

Objectifs et politique d'investissement

Le Fonds a pour objectif une appréciation à long terme de son capital.

Il s'attache à atteindre cet objectif principalement par l'investissement dans des actions, des contrats financiers pour différences sur actions (« **CFD sur actions** ») et des contrats à terme sur actions 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 identifier des actions qui vont surperformer ou sous-performer les marchés des actions. Le Fonds prend des positions longues ou courtes dans un portefeuille diversifié de près de 2 500 actions et cherche à réduire le risque par le biais d'une compensation positions longues - positions courtes.

Le Fonds peut investir dans des espèces et bons du Trésor 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 dans des contrats de change à terme et dans des devises à des fins de couverture.

Le Fonds peut investir jusqu'à 10 % de sa VNI dans d'autres organismes de placement collectif sélectionnés par le sous-gestionnaire de portefeuille.

Le Fonds peut investir dans une large mesure dans des CFD sur actions, dans des contrats à terme s sur actions et, à des fins de couverture, dans des contrats de change à terme. Le Fonds peut investir plus de 20 % de son actif net dans des titres domiciliés ou négociés dans les pays suivants : Brésil, Chili, Chine, Colombie, République tchèque, Égypte, Grèce, Hongrie, Inde, Indonésie, Corée, Malaisie, Mexique, Pérou, Philippines, Pologne, Qatar, Afrique du Sud, Taïwan, Thaïlande, Turquie et Émirats arabes unis.

Le niveau de levier du Fonds se situe généralement à 500-700 % de sa VNI, mais des niveaux supérieurs ou inférieurs sont possibles.

Vous pouvez acheter et vendre vos actions tous les mercredis ou lors de tout autre jour ouvrable, selon les indications des administrateurs. Les ordres d'achat ou de vente peuvent être passés par transmission d'une demande à cet effet au plus tard à 17 h (heure irlandaise), trois jours ouvrables à l'avance, à l'agent administratif. Le paiement pour les ordres d'achat doit être reçu au plus tard à 17 h (heure irlandaise), deux jours ouvrables à l'avance.

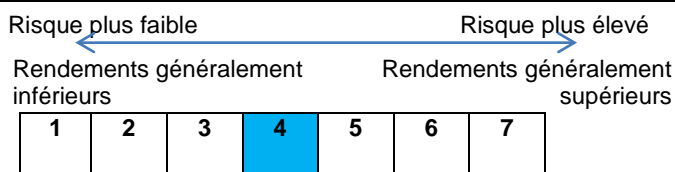
Vos Actions de non-distribution de catégorie A USD ne donnent pas de dividendes.

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 (« USD »). 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 d'investissement et des politiques, se reporter à la rubrique du supplément relatif au Fonds (le « **Supplément** ») intitulée « Objectifs et politiques d'investissement » au prospectus de l'ICAV (le « **Prospectus** »).

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

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. | | | | | | | | | | | | | |
| Frais forfaitaires prélevés avant ou après votre placement | | | | | | | | | | | | | |
| 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 | 2,44 % | | | | | | | | | | | | |
| Frais prélevés sur le Fonds dans certaines conditions spécifiques | | | | | | | | | | | | | |
| Commission de performance | Calculée sur la base d'une augmentation de la VNI par action de 20 % par rapport à la VNI précédente la plus haute de l'action concernée. | | | | | | | | | | | | |
| Le montant des frais courants se fonde sur les frais de l'exercice clos le 31 décembre 2017. Ils excluent les frais de transactions du portefeuille, sauf dans le cas des frais d'entrée/de sortie payés par le Fonds. Ce chiffre peut varier d'un exercice à l'autre. Pour plus d'informations sur les frais, veuillez consulter la rubrique intitulée « Frais et dépenses » du Prospectus et du Supplément. | | | | | | | | | | | | | |
| Performances passées | | | | | | | | | | | | | |
| <table border="1"> <caption>Performances passées</caption> <thead> <tr> <th>Année</th> <th>Performance</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>2013</td> <td>0.0%</td> </tr> <tr> <td>2014</td> <td>0.0%</td> </tr> <tr> <td>2015</td> <td>-2,7 %</td> </tr> <tr> <td>2016</td> <td>0.0%</td> </tr> <tr> <td>2017</td> <td>4,5 %</td> </tr> </tbody> </table> | Année | Performance | 2013 | 0.0% | 2014 | 0.0% | 2015 | -2,7 % | 2016 | 0.0% | 2017 | 4,5 % | <ul style="list-style-type: none"> • Les performances passées ne préjugent pas de performances futures. • De manière générale, les performances passées tiennent compte de tous les frais courants, mais pas des frais de conversion. • Le Fonds a été agréé par la Banque centrale d'Irlande le 29 mars 2015. • Le tableau illustre les performances annuelles du Fonds calculées en dollar américain. |
| Année | Performance | | | | | | | | | | | | |
| 2013 | 0.0% | | | | | | | | | | | | |
| 2014 | 0.0% | | | | | | | | | | | | |
| 2015 | -2,7 % | | | | | | | | | | | | |
| 2016 | 0.0% | | | | | | | | | | | | |
| 2017 | 4,5 % | | | | | | | | | | | | |
| Informations pratiques | | | | | | | | | | | | | |
| <ul style="list-style-type: none"> • L'actif de l'ICAV est aux mains de son dépositaire, la BNY Mellon Trust Company (Ireland) Limited. • 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, 2nd Floor, Block E Iveagh Court, Harcourt, Dublin 2, Irlande, 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. Les détails relatifs à la politique de rémunération de l'ICAV sont disponibles sur http://ucits.systematica.com et un exemplaire papier est disponible 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 de l'ICAV ne peut être engagée que sur la base de déclarations figurant dans le présent document qui seraient trompeuses, inexactes ou non cohérentes avec les parties correspondantes du Prospectus. • 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 non-distribution de catégorie A USD ont été choisies en tant que catégorie représentative de toutes les catégories d'actions de distribution et de non-distribution USD, GBP, EUR, CHF, AUD et JPY de catégorie A du Fonds. Pour plus d'informations sur les autres catégories d'actions du Fonds, veuillez consulter le Supplément. | | | | | | | | | | | | | |
| L'ICAV est agréée en Irlande et régulée par la Banque centrale d'Irlande. | | | | | | | | | | | | | |
| Les informations clés destinées aux investisseurs reprises dans le présent document sont réputées exactes en date du 15 février 2018. | | | | | | | | | | | | | |