

Documento contenente le informazioni chiave

Il presente documento contiene informazioni chiave relative a questo prodotto d'investimento. 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.

Helium Global Event Driven Fund (il "Comparto")
un comparto di SYQUANT ICAV (il "Fondo").
Azioni di categoria A EUR - (Codice ISIN: IE00042I28D2)
Società di gestione: Syquant Capital SAS (l'"Ideatore").

Sito web: www.syquant-capital.fr

Per maggiori informazioni, chiamare il numero +33 (0)1 42 56 56 20

La Banca Centrale Irlandese (Central Bank of Ireland, CBI) è responsabile della vigilanza di Syquant Capital SAS in relazione al presente Documento contenente le informazioni chiave.

Il presente PRIIP è autorizzato in Irlanda.

Syquant Capital SAS è autorizzata in Francia e regolamentata dall'AMF. (Agreement Number GP 05000030 consegnato il 27/09/2005).

Data di realizzazione del documento contenente le informazioni chiave: 24/06/2024

Cos'è questo prodotto?

Tipo

Il Comparto è un comparto del Fondo, il quale è un veicolo di gestione patrimoniale collettiva irlandese (ICAV), autorizzato dalla Banca Centrale Irlandese in qualità di FIA riservato ad investitori qualificati (Qualifying Investor AIF) ai sensi dell'ICAV Act e dell'AIF Rulebook. Non ha una scadenza definita.

Termine

Il prodotto non ha una data di scadenza. Ciononostante, il Comparto può essere chiuso alle condizioni stabilite nel Prospetto e nello Statuto del Fondo.

Obiettivi

Obiettivo di investimento

L'obiettivo di investimento del Comparto consiste nel conseguire un rendimento assoluto sfruttando le opportunità offerte dalle quotazioni di titoli, strumenti finanziari derivati e titoli di debito.

Politica di investimento

La Società di gestione ritiene che sia possibile generare rendimenti assoluti interessanti sfruttando le opportunità offerte dai prezzi di titoli, strumenti finanziari derivati e titoli di debito e cercherà di conseguire rendimenti assoluti e di garantire che la performance del Comparto presenti un basso grado di correlazione con quella dei mercati del debito e azionari.

Il Comparto non si limiterà a un'unica strategia di arbitraggio, ma utilizzerà un approccio multi-strategy. L'allocazione del capitale all'interno delle varie strategie avviene su base discrezionale, a seconda della valutazione del relativo profilo di rischio/rendimento effettuata dalla Società di gestione.

La Società di gestione cercherà di mantenere sempre un portafoglio d'investimento bilanciato per il Comparto, evitando concentrazioni eccessive in un singolo settore industriale o geografico.

Il Comparto sarà investito principalmente in strumenti sottostanti di emittenti situati in Europa e Nord America, ma anche potenzialmente e in chiave più selettiva in Asia, nelle Americhe e in Medio Oriente.

Il Comparto investirà principalmente in azioni, diritti, warrant, obbligazioni, obbligazioni convertibili, contratti per differenza, swap su azioni, valute e altri strumenti azionari, a reddito fisso e associati al credito. Il Comparto non investirà in asset-backed securities ("ABS") o in mortgage-backed securities ("MBS").

Il Comparto può altresì investire in strumenti finanziari derivati (quotati e over-the-counter) quali, tra l'altro, swap (compresi i total return swap), futures, contratti a termine su valute e opzioni, per scopi di investimento e di efficiente gestione del portafoglio.

Il Comparto può detenere strumenti equivalenti alla liquidità, come strumenti del mercato monetario e in particolare (ad es. titoli del

Tesoro, certificati di deposito, commercial paper, ecc.) al fine di raggiungere i propri obiettivi di investimento, per finalità di tesoreria e in caso di condizioni di mercato sfavorevoli.

Il Comparto può inoltre investire (fino al 10% del suo Valore patrimoniale netto) in special purpose acquisition companies ("SPAC"). In aggiunta, il Comparto può investire fino al 5% del suo Valore patrimoniale netto in società che si trovano nelle fasi antecedenti la quotazione in borsa (pre-IPO).

Il Comparto può effettuare investimenti denominati in una o più valute diverse dall'EUR e si riserva il diritto di effettuare operazioni di copertura valutaria in relazione a qualsiasi investimento in divise diverse dall'EUR per cercare di mitigare le fluttuazioni valutarie.

Il Comparto è a gestione attiva. Non esiste un parametro di riferimento ufficiale ai fini della performance e della gestione del portafoglio. Tuttavia, su un periodo di tre anni, la performance può essere confrontata, a posteriori, con il tasso privo di rischio specifico della valuta.

Politica della classe di azioni

I proventi netti del Comparto sono reinvestiti.

Elaborazione degli ordini di sottoscrizione e rimborso

Gli ordini di sottoscrizione e di rimborso devono pervenire al Depositario CACEIS Bank, Ireland Branch o a qualsiasi distributore incaricato entro le ore 17.00 (ora irlandese) del Giorno lavorativo precedente il Giorno di valutazione pertinente. Le richieste pervenute dopo la scadenza applicabile saranno elaborate in relazione al Giorno di valutazione successivo. I pagamenti relativi alle quote sottoscritte e rimborsate devono essere effettuati entro e non oltre 3 Giorni lavorativi a decorrere dal Giorno di valutazione pertinente.

Investitori al dettaglio cui si intende commercializzare il prodotto

Le azioni possono essere detenute esclusivamente da Investitori qualificati (fatte salve le esenzioni indicate nel Prospetto). I potenziali investitori devono certificare per iscritto di soddisfare i criteri minimi per essere considerati Investitori qualificati e di essere consapevoli dei rischi connessi all'investimento proposto e del fatto che tale investimento comporta la possibilità di perdere l'intera somma investita. Ogni cessionario di azioni (che si configuri come un nuovo azionista del Comparto) sarà tenuto a fornire una certificazione analoga prima della registrazione di qualsiasi trasferimento.

Depositario

CACEIS Bank, Ireland Branch

Informazioni aggiuntive

Si rimanda alla sezione "Altre informazioni rilevanti" più avanti.

Quali sono i rischi e qual è il potenziale rendimento?

Indicatore sintetico di rischio

1	2	3	4	5	6	7
---	---	---	---	---	---	---

← Rischio più basso Rischio più alto →



L'indicatore di rischio presuppone che il prodotto sia mantenuto per 3 anni.

Il rischio effettivo può variare notevolmente in caso di uscita anticipata e potreste non recuperare l'intero importo.

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 incapacità di pagarvi quanto dovuto.

Abbiamo classificato questo prodotto al livello 5 su 7, che corrisponde alla classe di rischio medio-alta. Ciò significa che le perdite potenziali dovute alla performance futura del prodotto sono classificate nel livello medio e che è probabile che le cattive condizioni di mercato influenzino la capacità di pagarvi quanto dovuto.

Attenzione al rischio di cambio. Riceverete pagamenti in una valuta straniera, quindi il rendimento finale che otterrete dipenderà dal tasso di cambio tra le due valute. Questo rischio non è contemplato nell'indicatore sopra riportato.

Altri rischi particolarmente rilevanti per il PRIIP non compresi nell'indicatore sintetico di rischio:

- Rischio di controparte
- Rischio operativo

Per maggiori informazioni si rimanda al Prospetto.

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

Performance Scenari

Le cifre riportate comprendono tutti i costi del prodotto in quanto tale, ma possono non comprendere tutti i costi da voi pagati al consulente o al distributore. Le cifre non tengono conto della vostra situazione fiscale personale, che può incidere anch'essa sull'importo del rimborso. Il possibile rimborso dipenderà dall'andamento futuro dei mercati, che è incerto e non può essere previsto con esattezza.

Lo scenario sfavorevole, lo scenario moderato e lo scenario favorevole riportati sono illustrazioni basate sulla performance peggiore, la performance media e la performance migliore del prodotto e del parametro di riferimento idoneo negli ultimi dieci anni. Nel futuro i mercati potrebbero avere un andamento molto diverso.

Periodo di detenzione raccomandato:		3 anni	
Esempio di investimento:		€10,000	
Scenari		In caso di uscita dopo 1 anno	In caso di uscita dopo 3 anni
Minimo	Non esiste un rendimento minimo garantito. Potreste perdere il vostro intero investimento o parte di esso.		
Stress	Possibile rimborso al netto dei costi	€2,050	€2,850
	Rendimento medio per ciascun anno	-79.50%	-34.19%
Sfavorevole	Possibile rimborso al netto dei costi	€9,320	€11,140
	Rendimento medio per ciascun anno	-6.80%	3.66%
Moderato	Possibile rimborso al netto dei costi	€12,580	€17,720
	Rendimento medio per ciascun anno	25.80%	21.01%
Favorevole	Possibile rimborso al netto dei costi	€15,220	€23,770
	Rendimento medio per ciascun anno	52.20%	33.46%

Lo scenario di stress indica quale potrebbe essere l'importo rimborsato in circostanze di mercato estreme.

Scenario sfavorevole: Questo tipo di scenario si è verificato per un investimento che utilizza un parametro di riferimento idoneo tra il giorno aprile 2023 e il giorno aprile 2024.

Scenario moderato: Questo tipo di scenario si è verificato per un investimento che utilizza un parametro di riferimento idoneo tra il giorno dicembre 2018 e il giorno dicembre 2021.

Scenario favorevole: Questo tipo di scenario si è verificato per un investimento che utilizza un parametro di riferimento idoneo tra il giorno ottobre 2014 e il giorno ottobre 2017.

Cosa accade se Syquant Capital SAS non è in grado di corrispondere quanto dovuto?

L'investitore non rischia di subire una perdita finanziaria a causa dell'insolvenza dell'Ideatore. Le attività del Portafoglio e del Fondo sono custodite dal suo depositario, CACEIS Bank, Ireland Branch (il "Depositario"). In caso di insolvenza dell'Ideatore, le attività del Fondo custodite dal Depositario non saranno intaccate. Tuttavia, in caso di insolvenza del Depositario, o di un soggetto che agisce per suo conto, il Fondo potrebbe subire una perdita finanziaria. Questo rischio è mitigato in una certa misura dal fatto che, in base alla legge e alla regolamentazione vigente, il Depositario è tenuto a separare le proprie attività da quelle del Fondo. Il Depositario sarà inoltre responsabile nei confronti del Fondo per eventuali perdite derivanti, tra l'altro, da negligenza, frode o mancato rispetto intenzionale dei propri obblighi (fatte salve alcune limitazioni indicate nell'accordo con il Depositario). Le perdite non sono coperte da un sistema di indennizzo degli investitori o da un sistema di garanzia.

Quali sono i costi?

La persona che fornisce consulenza sul PRIIP o che lo vende potrebbe addebitare altri costi, nel qual caso fornirà informazioni su tali costi, illustrandone l'impatto sull'investimento.

Andamento dei costi nel tempo

Le tabelle mostrano gli importi prelevati dall'investimento per coprire diversi tipi di costi. Tali importi dipendono dall'entità dell'investimento e dalla durata della detenzione del prodotto. Gli importi sono qui riportati a fini illustrativi e si basano su un importo esemplificativo dell'investimento e su diversi possibili periodi di investimento. Si è ipotizzato quanto segue:

- nel primo anno recupero dell'importo investito (rendimento annuo dello 0%). Per gli altri periodi di detenzione si è ipotizzato che il prodotto abbia la performance indicata nello scenario moderato

- EUR 10.000

	In caso di uscita dopo 1 anno	In caso di uscita dopo 3 anni
Costi totali	€169	€753
Incidenza annuale dei costi (*)	1.7%	1.7% ogni anno

(*) Dimostra come i costi riducano ogni anno il rendimento nel corso del periodo di detenzione. Ad esempio, se l'uscita avviene nel periodo di detenzione raccomandato, si prevede che il rendimento medio annuo sarà pari al 22.7 % prima dei costi e al 21.0 % al netto dei costi.

Una parte dei costi può essere condivisa con la persona che vende il prodotto per coprire i servizi che fornisce. L'importo verrà comunicato in seguito. Si prega di notare che le cifre riportate non comprendono le commissioni di monitoraggio e le commissioni iniziali aggiuntive che potrebbero esservi addebitate dal distributore, dal consulente o da qualsiasi altro strumento assicurativo in cui il Fondo può essere investito.

Composizione dei costi

Costi una tantum di ingresso o di uscita		In caso di uscita dopo 1 anno
Costi di ingresso	Non addebitiamo una commissione di ingresso.	€0
Costi di uscita	Non addebitiamo una commissione di uscita per questo prodotto ma la persona che vende il prodotto può farlo.	€0
Costi correnti registrati ogni anno		
Commissioni di gestione e altri costi amministrativi o di esercizio	1.5% del valore dell'investimento all'anno. Si tratta di una stima basata sui costi effettivi dell'ultimo anno.	€147
Costi di transazione	0.2% del valore dell'investimento all'anno. Si tratta di una stima dei costi sostenuti per l'acquisto e la vendita degli investimenti sottostanti per il prodotto. L'importo effettivo varierà a seconda dell'importo che viene acquistato e venduto.	€22
Oneri accessori sostenuti in determinate condizioni		
Commissioni di performance (e carried interest)	20.0% della sovraperformance del Valore patrimoniale netto della categoria rispetto all'High water mark.	€0

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

Periodo di detenzione raccomandato: 3 anni

Il Periodo di detenzione raccomandato è stato fissato a 3 anni sulla base degli Obiettivi di investimento del Comparto e delle strategie attuate, come descritto nel relativo Prospetto. Tuttavia, ogni Giorno di valutazione sarà un giorno di rimborso e il Prospetto non prevede alcuna commissione di rimborso per i rimborsi effettuati prima della fine del Periodo di detenzione raccomandato. Le richieste di rimborso devono pervenire al Conservatore del registro e Agente per i trasferimenti o a qualsiasi distributore incaricato entro le ore 17.00 (ora irlandese) del giorno lavorativo precedente il Giorno di valutazione pertinente.

Come presentare reclami?

SYQUANT Capital, in ottemperanza alla regolamentazione vigente, ha implementato e mantiene una procedura operativa finalizzata a trattare in modo rapido ed efficiente i reclami. Gli eventuali reclami possono essere inviati a:

- RCCI@syquant.com

- o tramite posta ordinaria, all'indirizzo: 25 avenue Kléber 75116 Parigi, Francia.

Per ulteriori informazioni si rimanda alla sezione "Customer Complaints Management" (Gestione reclami clienti) del nostro sito web (<https://www.syquant-capital.fr/en/regulatory-information/>).

Altre informazioni pertinenti

Il Valore patrimoniale netto del Fondo, l'ultimo Prospetto e le informative periodiche più recenti, insieme a tutte le altre informazioni utili, sono disponibili gratuitamente in lingua inglese presso la Società di gestione (via e-mail all'indirizzo contact@syquant.com o sul sito web www.syquant-capital.fr).

La presentazione delle performance passate degli ultimi mesi (meno di un anno civile) e i calcoli degli scenari di performance precedenti sono disponibili all'indirizzo:

<https://www.syquant-capital.fr/wp-content/themes/syquant/docs/mps/en-IE00042I28D2%20Monthly%20Performance%20Scenario%20EN%20202212.pdf>

<https://www.syquant-capital.fr/wp-content/themes/syquant/docs/pp/en-IE00042I28D2%20Past%20Performance%20EN%20202212.pdf>