

Document d'Informations Clés

Le présent document contient des informations essentielles sur le produit d'investissement. Il ne s'agit pas d'un document à caractère commercial. Ces informations vous sont fournies conformément à une obligation légale, afin de vous aider à comprendre en quoi consiste ce produit et quels risques, coûts, gains et pertes potentiels y sont associés, et de vous aider à le comparer à d'autres produits.

Helium Alpha (le « Compartiment »)
un compartiment de HELIUM FUND (le « Fonds »).
Classe A-USD Actions - (Code ISIN : LU2113028521)
Société de gestion : Syquant Capital SAS (l'« Initiateur »).

Site Internet : www.syquant-capital.fr

Appelez le +33 (0)1 42 56 56 20 pour obtenir de plus amples informations

La Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF) est responsable de la supervision de Syquant Capital SAS en relation avec le présent Document d'Informations Clés.

Ce PRIIP est autorisé au Luxembourg.

Syquant Capital SAS est agréée en France et supervisée par l'AMF (Agrément n° GP 05000030 délivré le 27/09/2005).

Date de production du document d'informations clés: 26/02/2024

En quoi consiste ce produit ?

Type

Le Compartiment est un compartiment du Fonds, une SICAV (Société d'Investissement à Capital Variable) luxembourgeoise ayant obtenu la qualification d'organisme de placement collectif en valeurs mobilières (« OPCVM ») en vertu de la partie I de la loi de 2010. Il n'a pas d'échéance définie.

Durée

Le produit n'a pas de date d'échéance. Toutefois, le Compartiment peut être liquidé dans les conditions prévues par le Prospectus et les Statuts du Fonds.

Objectifs

Objectif d'investissement

Le Compartiment est un compartiment diversifié à gestion active qui vise à générer une performance absolue constante tout en maintenant un faible niveau de volatilité. Il n'existe donc aucun indice de référence officiel pour la performance. Toutefois, celle-ci peut être comparée rétroactivement sur une période de trois ans au Secured Overnight Financing Rate (SOFR).

Politique d'investissement

Afin d'atteindre ces objectifs, le Compartiment applique des stratégies d'arbitrage faiblement corrélées aux tendances du marché actions.

Ces stratégies sont liées aux marchés d'actions, de contrats futures ou d'instruments financiers avec une composante optionnelle, essentiellement de la zone géographique : Europe.

Les stratégies mises en place par le Compartiment concernent principalement, mais pas exclusivement, des stratégies Long/Short systématiques. Le Compartiment peut avoir recours à d'autres stratégies si celles-ci sont conformes à son objectif et à sa politique d'investissement.

Les allocations du portefeuille du Compartiment entre les différentes stratégies dépendent des conditions de marché et sont réalisées selon les estimations du gérant en termes de rendements escomptés.

La mise en œuvre des stratégies se fera sans contraintes en termes de secteur, de région ou de capitalisation. L'exposition aux devises découlant de ces investissements peut être couverte en tout ou en partie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10% de ses actifs dans des actions ou parts d'autres fonds français ou européens.

Le Compartiment peut investir jusqu'à 100% de ses actifs dans des titres de créance ou des instruments monétaires. La gestion de ces

instruments sera discrétionnaire et ne sera pas limitée en termes de notation et de répartition entre secteur public et privé.

Le Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et/ou sociales conformément à l'Article 8 du Règlement de l'UE sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (SFDR). De plus amples informations concernant la manière dont le Compartiment prend en compte les critères environnementaux et/ou sociaux sont disponibles dans le prospectus du Fonds et accessibles via www.syquant-capital.fr.

Le Compartiment est soumis à la politique d'investissement responsable de Syquant Capital.

Politique de classe d'actions

Les revenus nets du Compartiment sont réinvestis.

La classe d'actions est couverte contre le risque de change, sans garantie toutefois que cette couverture sera efficace.

Traitement des ordres de souscription et de rachat

Les ordres de souscription et de rachat sont centralisés tous les jeudis avant 17h00 (heure de Luxembourg) par le Dépositaire, CACEIS Bank, succursale de Luxembourg. Ils sont traités sur la base de la Valeur nette d'inventaire hebdomadaire du vendredi.

Investisseurs de détail visés

Ce fonds est destiné aux investisseurs particuliers et institutionnels qui ont de bonnes connaissances et une expérience des marchés financiers internationaux. Dès lors qu'il n'offre pas de protection du capital, les investisseurs particuliers doivent tenir compte de leur situation financière avant d'investir dans le fonds et être en mesure de supporter des pertes potentielles sur leur investissement. Les investisseurs particuliers doivent également vérifier l'adéquation de leur horizon d'investissement avec la période d'investissement recommandée, qui ne doit pas être inférieure à 5 ans. Les stratégies mises en œuvre dans le fonds visent à préserver le capital et à générer des performances absolues et régulières. Elles sont donc conformes aux objectifs des investisseurs particuliers qui recherchent des rendements absolus assortis d'une faible volatilité, bien que ces objectifs puissent ne pas être atteints.

Dépositaire

CACEIS Bank, succursale de Luxembourg

Informations Supplémentaires

Veillez consulter la section « Autres informations pertinentes » ci-dessous.

Quels sont les risques et qu'est-ce que cela pourrait me rapporter ?

Indicateur synthétique de risque (ISR)



← Risque le plus faible Risque le plus élevé →



L'indicateur de risque suppose que vous conservez le produit pendant 5 ans.

Le risque réel peut varier considérablement si vous encaissez à un stade précoce et vous pouvez récupérer moins.

L'indicateur synthétique de risque permet d'apprécier le niveau de risque de ce produit par rapport à d'autres. Il indique la probabilité que ce produit enregistre des pertes en cas de mouvements sur les marchés ou d'une impossibilité de notre part de vous payer.

Nous avons classé ce produit dans la classe de risque 3 sur 7, qui est une classe de risque entre basse et moyenne. Autrement dit, les pertes potentielles liées aux futurs résultats du produit se situent à un niveau entre faible et moyen et, si la situation venait à se détériorer sur les marchés, il est peu probable que la capacité à vous payer en soit affectée.

Attention au risque de change. Les sommes qui vous seront versées le seront dans une autre monnaie; votre gain final dépendra donc du taux de change entre les deux monnaies. Ce risque n'est pas pris en compte dans l'indicateur ci-dessus.

Autres risques matériellement pertinents pour le PRIIP mais non repris dans l'indicateur synthétique de risque :

- Risque de contrepartie
- Risque opérationnel

Veillez consulter le prospectus pour de plus amples informations.

Ce produit ne prévoyant pas de protection contre les aléas de marché, vous pourriez perdre tout ou partie de votre investissement.

Scénarios de performance

Les chiffres indiqués comprennent tous les coûts du produit lui-même, mais pas nécessairement tous les frais dus à votre conseiller ou distributeur. Ces chiffres ne tiennent pas compte de votre situation fiscale personnelle, qui peut également influencer sur les montants que vous recevrez. Ce que vous obtiendrez de ce produit dépend des performances futures du marché. L'évolution du marché à l'avenir est incertaine et ne peut être prédite avec précision.

Les scénarios défavorable, intermédiaire et favorable présentés représentent des exemples utilisant les meilleure et pire performances, ainsi que la performance moyenne du produit et de l'indice de référence approprié au cours des 10 dernières années. Les marchés pourraient évoluer très différemment à l'avenir.

| Période de détention recommandée: | | 5 ans | |
|-----------------------------------|---|---------------------------|----------------------------|
| Exemple d'investissement: | | \$10,000 | |
| Scénarios | | Si vous sortez après 1 an | Si vous sortez après 5 ans |
| Minimum | Il n'existe aucun rendement minimal garanti. Vous pourriez perdre tout ou une partie de votre investissement. | | |
| Tensions | Ce que vous pourriez obtenir après déduction des coûts | \$6,730 | \$6,380 |
| | Rendement annuel moyen | -32.70% | -8.60% |
| Défavorable | Ce que vous pourriez obtenir après déduction des coûts | \$9,200 | \$9,740 |
| | Rendement annuel moyen | -8.00% | -0.53% |
| Intermédiaire | Ce que vous pourriez obtenir après déduction des coûts | \$10,110 | \$10,740 |
| | Rendement annuel moyen | 1.10% | 1.44% |
| Favorable | Ce que vous pourriez obtenir après déduction des coûts | \$11,820 | \$12,470 |
| | Rendement annuel moyen | 18.20% | 4.51% |

Le scénario de tensions montre ce que vous pourriez obtenir dans des situations de marché extrêmes.

Scénario défavorable : Ce type de scénario s'est produit pour un investissement utilisant un indice de référence approprié entre Novembre 2015 et Novembre 2020.

Scénario intermédiaire : Ce type de scénario s'est produit pour un investissement utilisant un indice de référence approprié entre Août 2018 et Août 2023.

Scénario favorable : Ce type de scénario s'est produit pour un investissement utilisant un indice de référence approprié entre Janvier 2014 et Janvier 2019.

Que se passe-t-il si Syquant Capital SAS n'est pas en mesure d'effectuer les versements ?

Vous ne pourrez pas subir de perte financière en raison de la défaillance de l'Initiateur. Les actifs du Compartiment et du Fonds sont conservés par leur dépositaire, CACEIS Bank, succursale de Luxembourg (le « Dépositaire »). Les actifs du Fonds conservés par le Dépositaire ne seront pas affectés par une éventuelle insolvabilité de l'Initiateur. Toutefois, en cas d'insolvabilité du Dépositaire, ou d'un prestataire agissant en son nom, le Fonds peut subir une perte financière. Ce risque est atténué dans une certaine mesure par l'obligation imposée au Dépositaire de séparer ses propres actifs de ceux du Fonds en vertu de la loi et de la réglementation. Le Dépositaire sera également responsable envers le Fonds de toute perte résultant, entre autres, d'une négligence, d'une fraude ou d'un manquement intentionnel de sa part à remplir correctement ses obligations (sous réserve de certaines limitations telles que définies contractuellement avec le Dépositaire). Les pertes ne sont pas couvertes par un système d'indemnisation des investisseurs ou de garantie.

Que va me coûter cet investissement ?

Il se peut que la personne qui vous vend ce produit ou qui vous fournit des conseils à son sujet vous demande de payer des coûts supplémentaires. Si c'est le cas, cette personne vous informera au sujet de ces coûts et vous montrera l'incidence de ces coûts sur votre investissement.

Coûts au fil du temps

Les tableaux présentent les montants prélevés sur votre investissement afin de couvrir les différents types de coûts. Ces montants dépendent du montant que vous investissez, du temps pendant lequel vous détenez le produit. Les montants indiqués ici sont des illustrations basées sur un exemple de montant d'investissement et différentes périodes d'investissement possibles. Nous avons supposé:

- qu'au cours de la première année vous récupérez le montant que vous avez investi (rendement annuel de 0%). Que pour les autres périodes de détention, le produit évolue de la manière indiquée dans le scénario intermédiaire

- USD 10,000

| | Si vous sortez après 1 an | Si vous sortez après 5 ans |
|---------------------------------|---------------------------|----------------------------|
| Coûts totaux | \$561 | \$2,305 |
| Incidence des coûts annuels (*) | 5.6% | 4.0% chaque année |

(*) Elle montre dans quelle mesure les coûts réduisent annuellement votre rendement au cours de la période de détention. Par exemple, elle montre que si vous sortez à la fin de la période de détention recommandée, il est prévu que votre rendement moyen par an soit de 5.4 % avant déduction des coûts et de 1.4 % après cette déduction.

Il se peut que nous partagions les coûts avec la personne qui vous vend le produit afin de couvrir les services qu'elle vous fournit. Cette personne vous informera du montant. Veuillez noter que les chiffres indiqués ici n'incluent pas les frais de suivi ou les frais initiaux supplémentaires qui peuvent être facturés par votre distributeur, votre conseiller ou toute enveloppe d'assurance dans laquelle le Fonds peut être placé.

Composition des coûts

| Coûts ponctuels à l'entrée ou à la sortie | | Si vous sortez après 1 an |
|---|--|---------------------------|
| Coûts d'entrée | 2.0% du montant que vous payez au moment de l'entrée dans l'investissement. | Jusqu'à \$200 |
| Coûts de sortie | Nous ne facturons pas de coût de sortie pour ce produit, mais la personne qui vous vend le produit peut le faire. | \$0 |
| Coûts récurrents prélevés chaque année | | |
| Frais de gestion et autres frais administratifs et d'exploitation | 2.2% de la valeur de votre investissement par an. Cette estimation se base sur les coûts réels au cours de l'année dernière. | \$221 |
| Coûts de transaction | 0.7% de la valeur de votre investissement par an. Il s'agit d'une estimation des coûts encourus lorsque nous achetons et vendons les investissements sous-jacents au produit. Le montant réel varie en fonction de la quantité que nous achetons et vendons. | \$71 |
| Coûts accessoires prélevés sous certaines conditions | | |
| Commissions liées aux résultats (et commission d'intéressement) | 20.0% net de la surperformance par rapport au Secured Overnight Financing Rate (SOFR) avec High Water Mark. | \$69 |

Combien de temps dois-je le conserver et puis-je retirer de l'argent de façon anticipée ?

Période de détention recommandée: 5 années

La Période de détention recommandée a été fixée à 5 ans sur la base des Objectifs d'investissement du Compartiment et des stratégies mises en œuvre, telles que décrites dans son Prospectus. Cependant, chaque Jour d'évaluation sera un jour de rachat et aucun frais de rachat n'est prévu dans le Prospectus au titre d'un rachat demandé avant la fin de la Période de détention recommandée. Les demandes de rachat doivent parvenir à l'Agent de registre et de transfert ou à tout autre distributeur désigné au plus tard à 17h00 (heure de Luxembourg) le jour ouvrable précédant le Jour d'évaluation concerné.

Comment puis-je formuler une réclamation ?

SYQUANT Capital, conformément à la réglementation, a établi et maintient une procédure opérationnelle visant à traiter de manière efficace et rapide les réclamations adressées par ses clients. Toute réclamation peut être adressée à l'adresse :

- RCCI@syquant.com

- Ou par courrier à l'adresse : 25 avenue Kléber 75116 Paris, France.

Pour de plus amples informations, veuillez consulter la section Traitement des réclamations de notre site Internet (<https://www.syquant-capital.fr/mentions-reglementaires/>).

Autres informations pertinentes

La Valeur nette d'inventaire du Fonds, le prospectus et les rapports périodiques les plus récents, ainsi que toutes les autres informations utiles, sont disponibles gratuitement en anglais auprès de la Société de gestion (par e-mail à contact@syquant.com ou sur le site Internet www.syquant-capital.fr).

Les performances passées présentées pour les 3 dernières années et les calculs des scénarios de performance précédents sont disponibles à l'adresse

<https://www.syquant-capital.fr/wp-content/themes/syquant/docs/mps/fr-LU2113028521%20Monthly%20Performance%20Scenario%20FR%20202212.pdf>

<https://www.syquant-capital.fr/wp-content/themes/syquant/docs/pp/fr-LU2113028521%20Past%20Performance%20FR%20202212.pdf>