

DOCUMENT D'INFORMATION CLE POUR L'INVESTISSEUR

Ce document fournit des informations essentielles aux investisseurs de cet OPCVM (le "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.

AEQUAM DIVERSIFIED Part S2

Société de gestion
ISIN

AEQUAM CAPITAL
FR0010973347



Objectifs et politique d'investissement

- L'orientation de gestion du Fonds est de rechercher une performance absolue et peu volatile quelle que soit la conjoncture des marchés, en utilisant des techniques de gestion quantitatives et systématique.
- A titre indicatif, l'investisseur peut comparer la performance du Fonds avec le taux LIBOR (London InterBank Offer Rate) USD « overnight » capitalisé. Le LIBOR USD est le taux moyen interbancaire au jour le jour sur le marché londonien pour les dépôts en USD.
- La durée de placement recommandée est de trois (3) ans minimum.
- Le Fonds est un OPCVM diversifié.
- Partie Systématique**

Le Fonds s'efforce de restituer les performances d'un indice de stratégie dénommé « **Aequam Diversified Index** » (« l'Indice ») par l'intermédiaire d'un swap de performance (le « **Swap** »).

Moteur principal de performance, l'Indice réplique une stratégie reposant sur des processus de sélection des instruments financiers fondés sur le traitement du signal au moyen d'un moteur quantitatif appelé "Dynamic Risk Allocation" ("DynA"). Le DynA analyse les prix de marché des classes d'actifs considérées pour constituer l'Indice. Le DynA est programmé pour délivrer une VaR et un niveau de margin-to-equity prédéfinis (contraintes de risque). Le portefeuille de l'Indice est construit en utilisant ces contraintes de façon à délivrer un niveau de risque prédéterminé. Afin d'optimiser le couple rendement/risque, une diversification importante des investissements, en terme de classes d'actifs sera effectuée, avec une exposition de l'Indice sur les taux d'intérêts, les indices actions, les devises et les matières premières à travers des

investissements sur divers contrats financiers (futures et forwards). Ces contraintes de risques réduisent le potentiel de performance de la stratégie en même temps que le niveau de risque du Fonds.

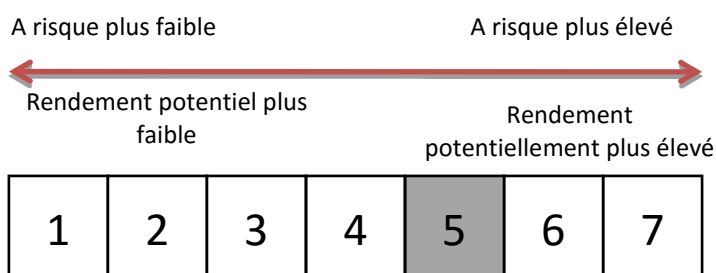
Partie Monétaire

Dans le cadre de la gestion de sa trésorerie, le Fonds peut investir jusqu'à 100 % de son actif dans des instruments du marché monétaire et des titres de créance émis par des entités dont le siège social ou l'implantation principale est situé dans un pays membre de l'OCDE. Ces titres sont soit des emprunts d'Etat, soit des émissions du secteur privé. Les notations minimales des instruments monétaires sont de A- (notation S&P et Fitch) ou A3 (notation Moody's).

Le Fonds peut investir jusqu'à 10 % de son actif en parts ou actions d'OPCVM (monétaire ou monétaire court terme).

- Les Parts du Fonds font l'objet d'une capitalisation pure : les sommes distribuables sont intégralement capitalisées à l'exception de celles qui feraient l'objet d'une distribution obligatoire en vertu de la loi.
- La Valeur Liquidative du Fonds est établie sur une base hebdomadaire chaque vendredi (Jour J). Les ordres de souscription et de rachats sont centralisés par le Dépositaire en J-1 avant 12 heures (heure de Paris) et sont exécutés en J+2 ouvrés sur la Valeur Liquidative calculée en J+1 ouvré. Une valeur estimative est calculée le dernier jour ouvré du mois si ce jour ne correspond pas à un vendredi. Elle ne donnera pas lieu à souscription rachat ce jour-là.

Profil de risque et de rendement



L'évaluation du risque présentée ci-dessus reflète de manière raisonnable le risque auquel le Fonds peut être exposé sans nécessairement refléter le risque du Fonds en cas de circonstances ou d'événements nouveaux. Les changements d'orientation du Fonds dans les limites fixées par sa politique de placement peuvent aussi avoir une

incidence sur le profil de risque et de rendement. Les données historiques utilisées pour calculer l'indicateur synthétique pourraient ne pas constituer une indication fiable du profil de risque futur du Fonds. La catégorie de risque associée à ce Fonds n'est pas garantie et peut évoluer dans le temps. Une classification dans la catégorie de risque la plus basse ne signifie pas que le Fonds est sans risque. Le Fonds n'est pas garanti en capital.

Risques non suffisamment pris en compte par l'indicateur, auxquels le Fonds peut être exposé et pouvant entraîner une baisse de la valeur liquidative :

Risque de contrepartie : Le Fonds court le risque de voir ses contreparties au Swap ou à des opérations à terme de change devenir insolvables.

Pour plus d'informations sur les risques, veuillez-vous référer aux pages 12 à 14 du prospectus du Fonds.

Frais

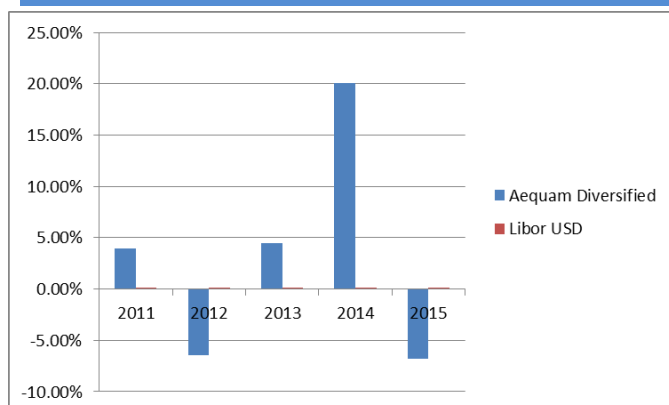
Frais ponctuels prélevés avant ou après investissement	
Frais d'entrée	3 % maximum
Frais de sortie	Néant
Les frais d'entrée et de sortie indiqués sont les frais maximums pouvant être prélevés sur votre capital avant que celui-ci ne soit investi ou avant que le revenu de votre investissement ne vous soit distribué. Dans certains cas, l'investisseur peut payer moins. L'investisseur peut obtenir de son conseiller financier ou de son distributeur le montant effectif des frais d'entrée et de sortie.	
Frais prélevés par le Fonds sur une année	
Frais courants	Parts S : 1 % TTC (*)
Frais prélevés par le Fonds dans certaines circonstances	
Commission de performance	20 % TTC de la performance supérieure au LIBOR USD et selon le principe dit de « High Water Mark ». Commission réelle prélevée lors de l'exercice précédent : 0%

(*) Les données relatives aux frais courants dans le tableau ci-contre se fondent sur les frais de l'exercice précédent clos le 31/12/2015 et peuvent varier d'une année à l'autre. Ils ne comprennent ni la commission de performance ni les frais d'intermédiation, excepté dans le cas de frais d'entrée et/ou de sortie payés par le Fonds lorsqu'il achète ou vend des actions / parts d'un autre véhicule de gestion collective.

Pour plus de précision sur les frais, veuillez-vous référer aux pages 18 à 20 du prospectus du Fonds disponible sur le site internet www.aequamcapital.com.

Les frais et commissions acquittés servent à couvrir les coûts d'exploitation du Fonds y compris les coûts de commercialisation et de distribution des parts, ces frais réduisent la croissance potentielle des investissements.

Performances passées



Date de lancement et monnaie du Fonds

Le Fonds a été lancé le 17 décembre 2010 sous la forme d'un fonds contractuel. Le fonds est agréé UCITS depuis le **12/06/2012**.

Les performances passées sont calculées en dollars.

Veuillez noter que la performance passée ne constitue pas une indication fiable des performances futures.

Frais et commissions

Le calcul de la performance passée est effectué après prise en compte des frais courants du Fonds et de la commission de performance. Les frais d'entrée et de sortie sont exclus du calcul de la performance passée.

Informations pratiques

- **Dépositaire** : CACEIS BANK FRANCE

- **Lieu et modalités d'obtention d'information sur le Fonds (prospectus/rapport annuel/document semestriel)** :

La documentation du Fonds ainsi que les documents d'information à l'attention des investisseurs sont disponibles sur demande auprès de la Société de Gestion :

AEQUAM Capital SAS

Service Clients

Palais Brongniart - 28, Place de la Bourse

75002 PARIS - FRANCE

E-mail : info@aequamcapital.com

Tel : **+33 (1) 73 01 93 71**

Fax : **+33 (1) 83 62 28 33**

- **Lieu et modalités d'obtention d'autres informations pratiques notamment sur la Valeur Liquidative** :

La Valeur Liquidative est disponible auprès de la Société de Gestion et sur son site internet :

AEQUAM Capital SAS

Service Clients

Palais Brongniart - 28, Place de la Bourse

75002 PARIS - France

www.aequamcapital.com

- **Fiscalité** :

Le Fonds n'est pas soumis à l'impôt sur les sociétés en France. En revanche, les distributions ou les plus ou moins-values éventuelles afférentes aux Parts du Fonds peuvent être soumises à taxation. Le régime fiscal applicable aux sommes distribuées par le Fonds ou aux plus ou moins-values latentes ou réalisées dépend des dispositions fiscales applicables à la situation particulière du Porteur et/ou de la juridiction d'investissement du Fonds. En cas de doute sur sa situation fiscale, il est conseillé au Porteur de s'adresser à un professionnel ou à son conseil fiscal habituel. Cette analyse pourrait, selon le cas, leur être facturée par leur conseiller et ne saurait en aucun cas être prise en charge par le Fonds ou la société de gestion.

La responsabilité de la Société de Gestion, Aequam Capital, ne peut être engagée que sur la base de déclarations contenues dans le présent document qui seraient trompeuses, inexactes ou non cohérentes avec les parties correspondantes du Prospectus du Fonds.

Le Fonds est agréé par la France et réglementé par l'AMF. Les informations clés pour l'investisseur ici fournies sont exactes et à jour au **05/02/2016**.