

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 est conseillé de le lire pour décider en connaissance de cause d'investir ou non.

Barclays US Equities Volatility Premium Fund Catégorie d'actions E USD (ISIN: LU2049330819)

un compartiment de Celsius Investment Funds SICAV. Ce Fonds est géré par FundRock Management Company S.A. (La "Société de Gestion")

Objectifs et politique d'investissement

L'objectif du Celsius Investment Funds SICAV – Barclays US Equities Volatility Premium Fund (le « Fonds ») est de générer un rendement corrélé à la performance d'une stratégie sur des swaps de variance (la « Stratégie Short Variance ») par le biais de l'indice Barclays SWF7 (l'« Indice »). La gestion du Fonds est passive. La Stratégie Short Variance est une stratégie de volatilité liée aux actions qui reconduit des positions courtes sur des swaps de variance hebdomadaires sur l'indice S&P 500® et conclut théoriquement un nouveau swap de variance hebdomadaire à l'échéance (le « Swap de variance »). La Stratégie Short Variance mesure le résultat de la vente de swaps de variance hebdomadaires à l'échéance. Le swap de variance hebdomadaire a un rendement plancher à -100 %. La sélection des composants de la stratégie est basée sur des règles. À chaque date de rééquilibrage (chaque vendredi ou le jour ouvrable précédent), la Stratégie Short Variance prendra théoriquement une position courte sur un swap de variance hebdomadaire sur l'indice S&P 500® conçu pour atteindre un certain montant de véga pouvant aller jusqu'à 0,075 %.

Le Fonds investira dans des contrats financiers avec Barclays Bank PLC appelés dérivés afin d'obtenir un rendement lié à l'indice. Tout revenu issu du Fonds sera réinvesti et le Fonds ne versera aucun dividende.

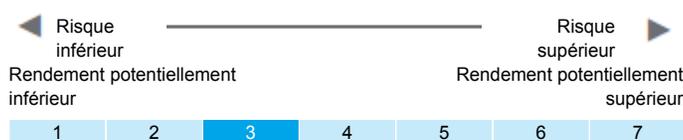
La valeur du Fonds est calculée et publiée chaque jour de bourse excepté les jours fériés légaux, comme indiqué dans le prospectus. Les investisseurs peuvent revendre leurs actions chaque jour ouvrable.

Lorsqu'il y a une souscription ou un rachat un jour qui est également une date de rééquilibrage hebdomadaire, il n'y aura pas d'ajustement du prélèvement anti-dilution au prix de souscription ou de rachat. Lorsqu'une souscription ou un rachat a lieu un autre jour, une taxe anti-dilution s'applique.

Le Fonds encourra des frais d'investissement dans le dérivé faisant référence à l'indice, ce qui aura une incidence négative sur le rendement du Fonds. Ces coûts s'ajoutent aux frais inclus dans « Coûts et frais associés ».

L'indice est calculé et publié net de coûts intégrés qui reflètent les coûts d'offre et de demande pour les swaps de variance. Ces coûts intégrés, qui peuvent varier dans le temps en fonction du niveau de volatilité implicite, auront une incidence indirecte sur le rendement du Fonds. La moyenne historique des coûts intégrés de l'indice sur la base des données de 2008 à 2020 s'élève à 3,00 % par an.

Indicateurs de risque (%)



La catégorie de risque et de rendement se calcule à l'appui de données historiques et ne représente pas forcément une indication fiable du profil de risque futur du Fonds.

La catégorie de risque et de rendement peut évoluer dans le temps et ne constitue ni un objectif, ni une garantie.

La catégorie la plus faible (c.-à-d. la Catégorie 1) ne signifie pas sans risque.

Le Fonds relève de la Catégorie 3 du fait de la faible amplitude et de la fréquence des fluctuations des cours (volatilité) des investissements sous-jacents référencés par le Fonds.

Les risques supplémentaires qui ne sont pas couverts par la catégorie de risque et de rendement sont recensés ci-dessous.

Les risques supplémentaires suivants ne sont pas couverts par la catégorie risque et rendement.

Le Fonds ne fournit aucune garantie du capital et n'est pas protégé. Vous pouvez par conséquent perdre la totalité ou une partie de votre investissement dans le Fonds.

Les coûts de l'instrument dérivé acquittés au niveau du Fonds donneront lieu à un écart de performance avec l'Indice.

Les Coûts de la Stratégie intégrés acquittés au niveau de la Stratégie Short Variance auront une incidence négative sur la performance du Fonds.

Le rendement du Fonds sera impacté de façon négative par les coûts intégrés de l'indice engagés au niveau de la stratégie de variance courte.

L'Indice peut évoluer à la hausse comme à la baisse et, par conséquent, la valeur du Fonds peut également varier à la hausse comme à la baisse. L'Indice peut sous-performer par rapport aux indices de la volatilité des actions en général.

Étant donné que les actifs du Fonds peuvent être libellés dans des devises autres que la devise de référence du Fonds et la devise de la classe d'actions, votre investissement peut être affecté par des taux de change. Le Fonds utilise des instruments dérivés pour tenter de réduire l'effet des fluctuations de change entre la devise de ses actifs et la devise de la classe d'actions (connu sous le nom de couverture). L'efficacité des stratégies de couverture n'est pas garantie et elles peuvent empêcher le Fonds de bénéficier d'une augmentation de la valeur d'une devise spécifique. Les actifs du Fonds se composent essentiellement d'un instrument dérivé avec Barclays Bank PLC. En cas de défaillance de Barclays Bank PLC, le Fonds ne sera pas en mesure d'atteindre son objectif et il se peut que vous perdiez la totalité ou une partie de votre investissement.

L'investissement dans le Fonds peut être affecté par des risques opérationnels des prestataires de services envers le Fonds. Afin d'éviter toute confusion, cela inclut la garde des actifs, ce qui relève de la responsabilité du Dépositaire. La valeur de l'investissement dépendra d'un certain nombre de facteurs.

De plus amples informations sur les risques en général figurent à la section « Facteurs de risque » du prospectus du Fonds.

Frais

Les frais que vous acquittez servent à couvrir les coûts d'exploitation du Fonds, y compris ses coûts de commercialisation et de distribution. Ces frais réduisent la croissance potentielle de votre investissement.

Frais ponctuels prélevés avant ou après investissement		Les frais d'entrée et de sortie indiqués sont des montants maximaux. Dans certains cas, ils peuvent être inférieurs. Vous pouvez obtenir des explications à ce sujet auprès de votre conseiller financier ou distributeur.
Droits d'entrée maximum	Néant	
Frais de sortie	Néant	
Il s'agit du montant maximal pouvant être prélevé sur votre capital avant son investissement (frais d'entrée) et avant que le produit de votre investissement (frais de sortie) soit remboursé.		Le montant des frais courants correspond à une estimation basée sur le total des charges anticipées. Il peut varier d'année en année. Ceux-ci excluent les frais de transaction du portefeuille et les commissions de performance, le cas échéant. Le rapport annuel du Fonds pour chaque exercice spécifiera le montant exact de ces frais.
Frais prélevés sur le Fonds sur un exercice		
Frais courants	0,26%	
Frais prélevés sur le Fonds dans certaines circonstances		De plus amples informations sur les frais figurent à la section «Frais et Commissions» du prospectus du Fonds.
Commission de performance	Néant	

Performances annuelles (%)

Les données sont insuffisantes pour permettre aux investisseurs d'avoir une indication fiable des performances passées.

Les performances passées ne constituent pas une indication fiable des performances futures.

Le Fonds a été lancé le 31 janvier 2020 et la catégorie d'actions a été lancée le 28 mai 2021.

Informations pratiques

Le dépositaire est Northern Trust Global Services SE.

Le Prospectus, qui contient d'autres informations à propos du Fonds, le dernier rapport annuel et tous les rapports semestriels subséquents sont disponibles en anglais avec le Document d'informations clés pour l'investisseur en anglais et français. Ils sont disponibles gratuitement sur demande auprès du siège social du Fonds ou auprès de votre conseiller financier ou distributeur. Le Prospectus et les rapports périodiques sont préparés pour Celsius Investment Funds SICAV dans son ensemble. Les derniers cours du Fonds et des actions seront disponibles auprès de l'Agent administratif du Fonds. Vous pourriez avoir le droit d'effectuer un échange entre différents Fonds de Celsius Investment Funds SICAV, mais cela peut entraîner des coûts pour vous. Des informations détaillées sur ce processus sont disponibles auprès de votre conseiller financier ou distributeur. La Société de Gestion a établi et applique une politique de rémunération conformément aux principes fixés en vertu de la directive UCITS V et de toute disposition juridique et réglementaire y afférente applicable au Luxembourg. La version actualisée de la politique de rémunération de la Société de gestion comprenant, entre

autres, une description du calcul de la rémunération et des avantages, l'identité des personnes responsables de l'attribution de la rémunération et des avantages, y compris la composition du comité de rémunération, est disponible sur <https://www.fundrock.com/remuneration-policy/> et un exemplaire papier sera disponible gratuitement et sur demande auprès du siège social de la Société de gestion .

Le régime fiscal applicable au Fonds en Luxembourg peut avoir une incidence sur votre situation fiscale personnelle.

La responsabilité de FundRock Management Company S.A. ne peut être engagée que sur la base de déclarations contenues dans le présent document qui seraient trompeuses, inexactes ou incohérentes avec les parties correspondantes du prospectus du Fonds.

Celsius Investment Funds SICAV possède plusieurs sous-fonds différents. Les actifs et les dettes de chaque sous-fonds sont structurés conformément à la loi et votre investissement dans le Fonds ne doit pas être utilisé pour couvrir les dettes d'un autre sous-fonds.

Ce Fonds est agréé en Luxembourg et réglementé par Commission de Surveillance du Secteur Financier («CSSF»).

FundRock Management Company S.A. est agréée au Luxembourg et réglementée par la Commission de Surveillance du Secteur Financier («CSSF»)

Les informations clés pour l'investisseur ici fournies sont exactes et à jour au 2022-08-31.