

Basfakta för investerare

Detta faktablad riktar sig till investerare och innehåller basfakta om denna fond. Det är inte reklammaterial. Det är information som krävs enligt lag för att hjälpa dig att förstå vad en investering i fonden innebär och riskerna med detta. Du rekommenderas att läsa den så att du kan fatta ett välgrundat investeringsbeslut.

CFM Quant Sustainable Absolute Return Fund ("Fonden"), en delfond som tillhör CFM UCITS ICAV ("ICAV")

Klass I-andelar (EUR) (ISIN: IE00BMXYZ521)
Fonden förvaltas av Capital Fund Management S.A. ("Förvaltaren")

Mål och placeringsinriktning

Fondens investeringsmål är att uppnå långsiktig kapitaltillväxt.

I sin strävan att uppnå sitt investeringsmål kommer Fonden att, direkt eller indirekt genom finansiella derivatinstrument ("FDI"), i både investerings- och säkringssyfte, primärt handla med aktier. FDI är investeringar vars pris baseras på en eller fler underliggande tillgångar som Fonden inte fysiskt äger och som exempelvis kan replikera utvecklingen eller kassaflödet hos de underliggande tillgångarna.

Ett FDI är ett kontrakt mellan två eller flera parter vars värde baseras på en överenskommen underliggande finansiell tillgång, index eller säkerhet.

Fonden syftar till att uppnå sitt investeringsmål genom att investera i en diversifierad portfölj med aktier och FDI i enlighet med CFM Quant Sustainable Absolute Return Program ("Programmet") som utvecklats av Förvaltaren. Fonden är en fond med kvantitativ handel, vilket innebär att Programmet verkställer transaktioner för Fonden baserat på systematiska modeller och matematiska formler, och investerar i tillgångar inom Fondens investeringsfår.

Hållbarhetshänsyn är helt integrerade i investeringsprocessen och används för att utvärdera företagens beteende och inverkan i förhållande till deras betydande intressenter och hållbarhetsarbete.

Fonden fokuserar inte på någon särskild geografisk region eller bransch. Fonden söker investera i tillgångar som är likvida och generellt sett lätta att värdera. Förvaltaren får även investera i vad denne bedömer vara tillväxtmarknader. Fonden kommer emellertid inte att investera mer än 20 % av substansvärdet på sådana tillväxtmarknader.

Fonden kommer främst att investera i FDI i investerings- och säkringssyfte men använder även FDI i säkringssyfte, med målet att minska risken av negativa prisrörelser hos en tillgång på grund av vissa förändringar, exempelvis förändringar av valutakurser eller räntor. Fonden kan även investera i andra kollektiva investeringssystem och kompletterande likvida tillgångar (inklusive banktillgodohavanden och obligationer) för att förvalta kassainnehavet.

Fonden kan ha en hävstång på upp till 100 % av sitt substansvärde.

Fondens intäkter och utdelning kommer att återinvesteras och öka värdet på din investering.

Fondens basvaluta är euro och dina andelar kommer att vara noterade i euro.

Du kan lösa in dina andelar på begäran alla affärsdagar då affärsbankerna är öppna i Dublin och New York.

Risk-/avkastningsprofil

← **Lägre risk** / **Högre risk** →
Lägre möjlig avkastning / Högre möjlig avkastning

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

Indikatorn ovan visar Fondens position på en standardiserad skala över risk/avkastningskategorier. Det finns inga garantier för att den risk/avkastningskategori som identifierats förblir oförändrad utan den kan komma att förändras med tiden. Den lägsta kategorin innebär inte att investeringen är "riskfri". Indikatorn är inte ett mått på risken att du förlorar det belopp du investerat. Skalan med de sju kategorierna är komplex; till exempel innebär inte riskkategori 2 dubbel risk jämfört med en fond i riskkategori 1.

Fonden tillhör riskkategori 5 på grund av investeringarnas beskaffenhet. Investeringarna består främst av aktier och FDI med exponering mot de ovan beskrivna underliggande tillgångarna och har, baserat på historisk information, medelhög volatilitet.

Fonden kan även vara exponerad mot andra risker som inte reflekteras tillräckligt av riskindikatorn. Dessa kan bl.a. vara:

Kredit- och motpartsrisk: Fonden deponerar kontanter som marginal för sina FDI-positioner hos motparter och kan investera i skuldpaper eller penningmarknadsinstrument. Fonden är därför mer exponerad mot risken att en motpart inte kan uppfylla sina ekonomiska åtaganden eller går i konkurs.

Derivat- och hävstångsrisik: Fonden använder FDI i investerings- och säkringssyfte, bl.a. för att hantera risk eller ta investeringspositioner på ett mer effektivt sätt än vad som annars skulle vara möjligt. FDI kan emellertid medföra hävstångseffekter och risk för högre volatilitet, vilket kan resultera i att Fonden exponeras mot ytterligare risker och kostnader. FDI medför möjligheten till högre avkastning men innebär även ökad risk för din investering.

Likviditetsrisk: Fonden gör betydande investeringar i FDI som till sin natur är tillräckligt likvida, men som i vissa fall kan ha relativt låg likviditet och därmed påverkar likviditetsrisken för hela Fonden.

Investeringsstrategirisik: Fondens framgångar beror på hur väl programmet presterar. Strategin förväntas ha måttlig volatilitet. Handelsbeslut tas baserat på en matematisk analys av tekniska faktorer som rör det historiska resultatet och aktiviteten på marknaden, och lönsamheten beror på strategins förmåga att fortsätta att framgångsrikt identifiera marknadstrender som programmet använder för att göra vinst.

För mer detaljerad information, se avsnittet "Riskfaktorer" i ICAV:s informationsbroschyr.

Avgifter för denna Fond

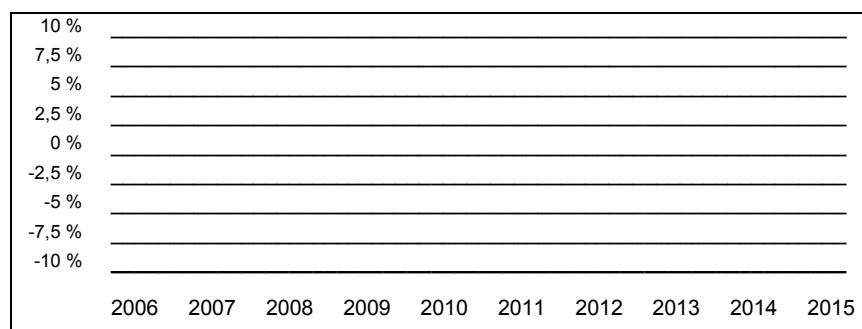
De avgifter du betalar används till att betala Fondens driftskostnader, inklusive kostnader för marknadsföring och distribution. Dessa avgifter minskar investeringens potentiella tillväxt.

| | |
|--|-------|
| Engångsavgifter som tas ut före eller efter du investerar | |
| Teckningsavgift | 0 % |
| Inlösenavgift | 0 % |
| Avgifter som debiteras Fonden under året | |
| Årlig avgift | 1,7 % |
| Avgifter som debiteras Fonden under särskilda omständigheter | |
| Resultatrelaterad avgift | 15 % |

De tecknings- och inlösenavgifter som visas är maximala avgifter. I vissa fall kan du betala mindre.

På grund av Fondens avsaknad av driftshistorik är den siffra som anges för den årliga avgiften endast en uppskattning. Denna siffra kommer troligtvis att variera från år till år. Fondens årsrapport kommer att innehålla närmare uppgifter om de exakta avgifterna. Mer information om avgifterna finns i informationsbroschyren i avsnittet "Avgifter och kostnader".

Tidigare resultat



Beräkningen av tidigare resultat tar inte hänsyn till tecknings- och inlösenavgifter, men tar hänsyn till den årliga avgift som nämnts ovan.

Tidigare resultat har beräknats i Fondens basvaluta, d.v.s. euro.

Det finns inte tillräckligt med information för att ge investerarna en användbar indikation om tidigare resultat.

Fonden auktoriserades av Irlands centralbank, Central Bank of Ireland, den 12 oktober 2020.

Praktisk information

- Förvaringsinstitutet är HSBC France, Dublin-filialen.
- Ytterligare information om Fonden, kopior av ICAV:s informationsbroschyr, fondbilagan samt de senaste hel- och halvårsrapporterna kan erhållas från ICAV:s sekreterare: MFD Secretaries Limited på 32 Molesworth Street, Dublin 2, Irland. Dessa dokument publiceras på engelska och kan erhållas utan kostnad. För information om andelsklasser, se fondbilagan. Information om Fondens övriga andelsklasser som är till salu i ditt land kan erhållas på begäran.
- De senaste andelspriserna kan erhållas från ICAV:s administratör, HSBC Securities Services (Ireland) DAC.
- Det beskattningssystem som gäller för Fonden i Irland kan påverka investerarnas personliga skattesituation.
- ICAV är en paraplyfond med segregerat ansvar mellan delfonder. Detta innebär att Fondens innehav hålls åtskilda enligt irländsk lag från innehaven i ICAV:s övriga delfonder, och att din investering i Fonden enligt irländsk lag inte kommer att påverkas av krav mot företagets övriga delfonder.
- Det är möjligt att byta dina andelar i Fonden mot andelar i Fondens övriga andelsklasser. Ingen bytesavgift tas ut för detta. Ytterligare information framgår av avsnittet "Utbyte av andelar" i informationsbroschyren. Information om ICAV:s övriga andelsklasser som är till salu i ditt land kan erhållas på begäran.
- ICAV kan hållas ansvarigt endast om ett påstående i detta faktablad är vilseledande, felaktigt eller oförenligt med de relevanta delarna av fondbilagan eller Fondens informationsbroschyr.
- Detaljerad information om Förvaltarens aktuella ersättningspolicy (bl.a. en beskrivning av hur ersättning och förmåner beräknas och identiteten hos de personer som ansvarar för att betala ut ersättning och förmåner) finns tillgänglig på <https://www.cfm.fr/assets/PoliciesDisclosures/Summary-Remuneration-Policy.pdf>. Ett pappersexemplar kan erhållas kostnadsfritt på begäran från Förvaltaren.
- Andelsklassen Klass I (EUR) har denna dag valts ut som representativ andelsklass för Fondens alla andelsklasser, förutom för andelsklassen Klass M.

ICAV är auktoriserad i Irland och står under tillsyn av Irlands centralbank, Central Bank of Ireland.

Förvaltaren är auktoriserad i Frankrike och står under tillsyn av Autorité des Marchés Financiers.

Dessa basfakta för investerare gäller per den 30 november 2020.