

DOCUMENT D'INFORMATIONS CLÉS (DIC)

OBJECTIF : 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 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.

PRODUIT

Avertissement : vous êtes sur le point d'acheter un produit qui n'est pas simple et qui peut être difficile à comprendre

RCUBE MULTI STRATEGIES – Part S – FR00140017Y5 - EUR

Ce FIA- FPS est déclaré en France et régulé par l'Autorité des marchés financiers.

Initiateur du PRIIP (Packaged Retail Investment and Insurance-based Products) : RCUBE ASSET MANAGEMENT

Siège social : 9 avenue Franklin D. Roosevelt – 75 008 Paris

Pour plus d'informations, veuillez-vous référer au site www.rcube.com ou appeler le +33 1 45 64 31 03

RCUBE ASSET MANAGEMENT est agréée en France et réglementée par l'Autorité des marchés financiers.

Date de production du Document d'Informations Clés : 02/01/2026

En quoi consiste ce Produit ?

TYPE

RCUBE MULTI STRATEGIES est un Fonds Commun de Placement (FCP), Fonds professionnel spécialisé non agréé par l'Autorité des marchés financiers dont les règles de fonctionnement sont fixées par le prospectus.

DURÉE

La durée de vie du FCP est de 99 ans. Ce produit n'est pas construit avec une date d'échéance.

OBJECTIFS

RCUBE MULTI STRATEGIES est un fonds d'investissements alternatifs qui a pour objectif de gestion un rendement absolu et décorrélé des principales classes d'actifs et indices de gestion alternative avec un ratio de Sharpe supérieur à 1 en ayant une volatilité annualisée inférieure ou égale à 10%. Le Fonds a pour vocation d'investir dans des fonds et stratégies de gestion alternative liquide sélectionnées et/ou gérées par Rcube Asset Management. Il pourrait s'agir de stratégies incubées par Rcube Asset Management.

Le FCP ne pourra pas investir plus de 60% de l'actif net dans un seul des OPCVM, des FIA, des fonds d'investissement étrangers sous-jacent de gestion alternative. La gestion est diversifiée et discrétionnaire selon les critères de sélection de la société de gestion.

Le FCP investit dans des OPCVM, des FIA, des fonds d'investissement étrangers ayant recours notamment aux stratégies dites « CTA (Commodity Trading Advisor) ou Managed Futures », « relative value », « arbitrage », et « Global macro ».

Le FCP pourra investir dans toute nature et origine géographique de fonds d'investissement étrangers y compris de pays non-membre de l'OCDE.

Le FCP pourra également investir directement dans des actions, des obligations, des instruments dérivés, et des devises à travers des poches de risque assignées à des gérants internes à la société de gestion.

Les stratégies « CTA » s'appuient principalement sur l'utilisation des marchés de contrats « futures », sur plusieurs fréquences, styles (systématique et/ou discrétionnaire), et classes d'actifs. Part de l'actif pour ces stratégies : de 0% à 100%.

Les stratégies « arbitrage/relative value » ont pour objectif d'exploiter des anomalies dans la formation des prix au sein de différentes catégories d'actifs. Ces stratégies portent sur des actions, des obligations et d'autres instruments de taux, des instruments financiers à terme, sur toute classe d'actifs et tout marché réglementé. Elles peuvent être systématiques et/ou discrétionnaires. Part de l'actif pour ces stratégies : de 0% à 50%.

Les stratégies « Global macro » reposent sur des prises de positions directionnelles sur les marchés actions, taux, devises ou matières premières, motivées par des anticipations macro-économiques au niveau international. Elles peuvent être systématiques et/ou discrétionnaires. Part de l'actif pour ces stratégies : de 0% à 50%.

Les stratégies « long/short » (« acheteur/vendeur ») qui pourraient être utilisées à la marge, ont pour caractéristique principale de gérer simultanément (a) des positions « long » (« acheteur ») constituées de titres ayant un potentiel de hausse et (b) des positions « short » (« vendeur ») constituées de titres ayant un potentiel de baisse, avec la possibilité de faire varier, selon les scénarios économiques, l'exposition nette au marché qui en résulte. Part de l'actif : de 0% à 20%.

Cet objectif de performance du fonds sera recherché dans le respect d'une « Value at risk » (VaR) ex ante de 1.5% maximum à horizon de 1 jour avec un intervalle de confiance de 95%. La gestion a également pour objectif une volatilité ex post cible moyenne annuelle inférieure à 10%.

Le niveau de l'effet de levier indicatif moyen du FCP est de 10. Le niveau de levier indicatif du FCP est calculé comme la somme des nominaux des positions sur les contrats financiers utilisés.

Résultat net et plus-values nettes : capitalisation

Recommandation : ce fonds pourrait ne pas convenir aux investisseurs qui prévoient de retirer leur apport dans les 3 ans.

Indicateur de référence (IR) : Aucun. L'objectif de gestion du FPS n'est pas compatible avec l'existence d'un indicateur de référence. Une telle comparaison ne pourrait qu'entraîner une mauvaise compréhension du porteur. Aucun indicateur de référence n'est ainsi défini, la recherche de performance est absolue.

INVESTISSEURS DE DÉTAIL VISÉS

Les parts S sont destinées aux clients professionnels (au sens de l'art. 533-11 du COMOFI), en contrepartie d'un risque de perte en capital. Les parts S ne sont disponibles que pendant les douze mois suivants la première émission d'actions du Fonds ou jusqu'à concurrence d'un montant maximal de souscriptions de parts de catégorie S de EUR 25 Millions, selon la première échéance, et par la suite, les parts de catégorie S seront fermées à la souscription.

INFORMATIONS COMPLÉMENTAIRES

Le FPS a été créé le 16 avril 2021.

La devise de référence est l'euro.

Méthode de gestion des risques : Valeur en risque absolue (VaR absolue).

DÉPOSITAIRE

CACEIS BANK

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

INDICATEUR DE RISQUE

Risque plus faible

Risque le plus élevé



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

L'indicateur de risque part de l'hypothèse que vous conservez le Produit jusqu'à la période de détention recommandée de 3 ans. Le risque réel peut être très différent si vous optez pour une sortie avant échéance, et vous pourriez obtenir moins en retour.

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 moyenne.

Autrement dit, les pertes potentielles liées aux futurs résultats du Produit se situent à un niveau moyen et, si la situation venait à se détériorer sur les marchés, il est possible que notre capacité à vous payer en soit affectée.

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

Veuillez consulter le Prospectus pour plus d'informations sur les risques spécifiques au Produit qui ne sont pas inclus dans l'indicateur synthétique de risque, tel que le risque de durabilité.

SCÉNARIOS DE PERFORMANCE

Ce tableau montre les sommes que vous pourriez obtenir sur la période de détention recommandée, en fonction de différents scénarios, en supposant que vous investissiez EUR 10 000.

Les différents scénarios montrent comment votre investissement pourrait se comporter. Vous pouvez les comparer avec les scénarios d'autres Produits.

Les scénarios présentés sont une estimation de performances futures à partir de données du passé relatives aux variations de la valeur de cet investissement. Ils ne constituent pas un indicateur exact. Ce que vous obtiendrez dépendra de l'évolution du marché et de la durée pendant laquelle vous conserverez l'investissement ou le Produit.

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

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.

| Exemple d'investissement de EUR 10 000 | | | |
|--|---|---------------------------|---|
| Scénarios | | Si vous sortez après 1 an | Si vous sortez après 3 ans (période de détention recommandée) |
| Minimum | Il n'existe aucun rendement minimal garanti. Vous pourriez perdre tout ou partie de votre investissement. | | |
| Scénario de tensions | Ce que vous pourriez obtenir après déduction des coûts | EUR 7 771 | EUR 7 290 |
| | Rendement annuel moyen | -22.29% | -10.00% |
| Scénario défavorable | Ce que vous pourriez obtenir après déduction des coûts | EUR 9 820 | EUR 10 378 |
| | Rendement annuel moyen | -1.80% | 1.24% |
| Scénario intermédiaire | Ce que vous pourriez obtenir après déduction des coûts | EUR 10 128 | EUR 10 583 |
| | Rendement annuel moyen | 1.27% | 1.91% |
| Scénario favorable | Ce que vous pourriez obtenir après déduction des coûts | EUR 10 600 | EUR 10 954 |
| | Rendement annuel moyen | 6.00% | 3.08% |

Que se passe-t-il si RCUBE ASSET MANAGEMENT n'est pas en mesure d'effectuer les versements ?

Les actifs de votre Produit sont conservés chez le Dépositaire de votre Produit, CACEIS BANK. En effet, vos versements et les actifs de votre Produit sont versés sur un ou plusieurs comptes bancaires ouverts au nom du Produit qui sont indépendants de ceux de RCUBE ASSET MANAGEMENT. Par conséquent, une défaillance de RCUBE ASSET MANAGEMENT serait sans effet sur votre investissement. La garde et la conservation des actifs de votre Produit sont en effet assurées par le Dépositaire.

Par ailleurs, en cas d'insolvabilité du Dépositaire ou d'un sous-dépositaire à qui la garde des actifs de votre Produit a pu être déléguée, il existe un risque potentiel de perte financière.

Toutefois, ce risque est atténué dans une certaine mesure par le fait que le Dépositaire est tenu par la loi et la réglementation de séparer ses propres actifs du Produit.

Enfin, il existe un dispositif d'indemnisation ou de garantie des investisseurs en cas de défaut du Dépositaire prévu par la loi.

Que va me coûter cet investissement ?

COÛT AU FIL DU TEMPS

La réduction du rendement (RIY) montre l'incidence des coûts totaux que vous payez sur le rendement que vous pourriez obtenir de votre investissement. Les coûts totaux incluent les coûts ponctuels, récurrents et accessoires.

Les montants indiqués ici sont les coûts cumulés liés au Produit lui-même, pour les différentes périodes de détention.

Ils incluent les pénalités de sortie anticipée potentielles. Les chiffres présentés supposent que vous investissiez EUR 10 000. Ces chiffres sont des estimations et peuvent changer à l'avenir.

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 l'ensemble des coûts sur votre investissement au fil du temps.

| Exemple d'investissement de EUR 10 000 | Si vous sortez après 1 an | Si vous sortez après 3 ans (période de détention recommandée) |
|--|---------------------------|---|
| Coûts totaux | EUR 125 | EUR 200 |
| Incidence sur le rendement (réduction du rendement) par an | 1.3 % | 0.6% chaque année |

COMPOSITION DES COÛTS

Sur la base d'un investissement de EUR 10 000 et un coût annuel si vous sortez après 1 an.

| Coûts ponctuels d'entrée ou de sortie | | Si vous sortez après 1 an |
|---|---|---------------------------|
| Coûts d'entrée | Cela comprend les coûts de distribution de 1.00% du montant investi. Il s'agit du montant maximal que vous paierez (il se pourrait que vous payiez moins). La personne qui vous vend le Produit vous informera des coûts réels. | Jusqu'à EUR 100 |
| Coûts de sortie | Nous ne facturons pas de frais de sortie pour ce Produit, mais la personne qui vous vend le Produit peut le faire. | EUR 0 |
| Coûts récurrents prélevés chaque année | | Si vous sortez après 1 an |
| Frais de gestion et autres coûts administratifs ou d'exploitation | 0.25% de la valeur de votre investissement par an. Ce pourcentage est basé sur les coûts réels au cours de la dernière année. | EUR 25 |
| Coûts de transaction | 0.00% de la valeur de vos investissements 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 variera en fonction du volume de nos achats et ventes. | EUR 0 |
| Coûts accessoires prélevés sous certaines conditions spécifiques | | Si vous sortez après 1 an |
| Commissions liées aux résultats et d'intéressement | Néant | EUR 0 |

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

PÉRIODE DE DÉTENTION RECOMMANDÉE : 3 ANS

Ce Produit est conçu pour un investissement à moyen terme. Vous devez être prêt à conserver votre investissement pendant au moins 3 ans. Vous pouvez toutefois demander à tout moment le remboursement de votre investissement sans pénalité durant cette période ou conserver votre investissement plus longtemps.

La valeur liquidative est calculée mensuellement le dernier jour ouvré du mois en J+1 (ouvré) à l'exception des jours fériés légaux en France et des jours de fermeture de la bourse de Paris (calendrier officiel Euronext). Les demandes de souscription et de rachat sont centralisées dix jours avant la valeur liquidative (J) avant 11 heures auprès du dépositaire, J étant le jour d'établissement de la valeur liquidative. Elles sont exécutées en J+2 ouvrés après publication de la valeur liquidative en J+15 ouvrés.

Comment puis-je formuler une réclamation ?

Si vous avez des réclamations, vous pouvez nous contacter :

- Par courrier postal à RCUBE ASSET MANAGEMENT- Service Clients - 9 avenue Franklin D. Roosevelt – 75 008 Paris
- Par email à info@rcube.com

Si toutefois, notre réponse ne vous satisfait pas, vous pouvez également saisir le Médiateur de l'AMF en utilisant le formulaire de demande de médiation sur le site de l'AMF : www.amf-france.org ou en écrivant à l'adresse suivante :

Médiateur de l'Autorité des Marchés Financiers
17 place de la Bourse, 75082 Paris Cedex 02, France

Autres informations pertinentes

Le prospectus, les derniers documents annuels et périodiques ainsi que la composition des actifs sont adressés gratuitement dans un délai de huit jours ouvrés sur simple demande écrite à la société de gestion : RCUBE ASSET MANAGEMENT - Service Clients – 9 avenue Franklin D. Roosevelt – 75008 PARIS – Tél : +33 1 45 64 31 03 – email : info@rcube.com. Ces informations sont disponibles dans la langue française.

La valeur d'actif nette des parts du Fonds ainsi que la documentation légale de la société sont disponibles sur le site internet www.rcube.com.

Classification SFDR : Article 6. Les informations relatives à la finance durable sont consultables en ligne sur www.rcube.com.

Performances passées : Vous pouvez consulter les performances passées du Fonds depuis sa création sur www.rcube.com.

Les performances passées ne sont pas constantes dans le temps et ne préjugent pas des performances futures.

La performance du Fonds est calculée dividendes et coupons nets réinvestis.

Les performances calculées le sont toutes charges incluses (elles ne prennent néanmoins pas en compte des éventuelles commissions d'entrée prélevées).