

Fonds Cyril Systematic (UCITS)

Cette part est destinée exclusivement aux investisseurs professionnels, qui sont invités à consulter la présente fiche conjointement au DICI et au prospectus du fonds. Le minimum d'investissement dans la part A est de 500 000 euros.

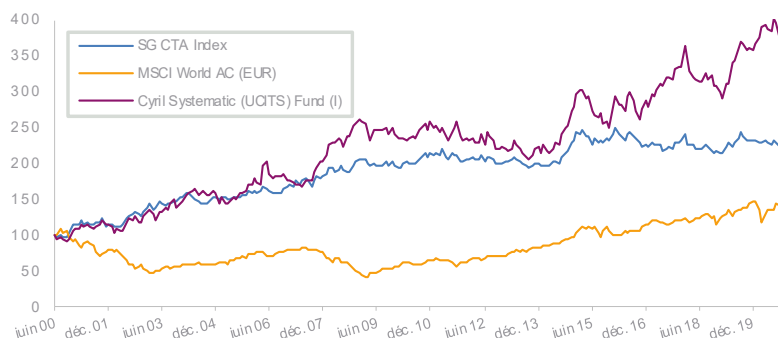
Descriptif du fonds

Historique de performance Part I

	Jan	Fév	Mars	Avr	Mai	Juin	Juil	Août	Sept	Oct	Nov	Déc	Année
2000							-4,39%	1,13%	-3,31%	-2,82%	4,43%	11,93%	6,19%
2001	2,75%	-0,15%	6,25%	-3,03%	2,28%	-2,63%	-2,77%	4,01%	2,08%	4,63%	-4,03%	-0,42%	8,67%
2002	-2,04%	-8,94%	5,90%	-1,76%	-1,74%	11,77%	4,10%	-0,40%	3,58%	-6,03%	-1,72%	9,10%	10,31%
2003	3,01%	2,72%	-4,52%	-5,12%	9,63%	-1,94%	5,11%	-2,67%	8,29%	2,45%	-6,88%	4,29%	13,58%
2004	2,12%	6,42%	0,80%	2,50%	1,44%	-5,89%	2,26%	2,10%	-3,56%	0,43%	3,89%	-2,84%	9,41%
2005	-9,69%	6,93%	-4,85%	-1,42%	2,91%	3,13%	-0,77%	5,98%	-1,16%	1,99%	5,46%	0,13%	7,63%
2006	5,28%	-3,33%	-1,49%	16,24%	1,62%	-8,02%	-2,60%	0,66%	0,42%	-0,26%	1,75%	-5,44%	2,91%
2007	0,92%	-2,14%	-1,15%	0,49%	-2,45%	5,24%	0,66%	-0,23%	7,01%	2,47%	4,02%	0,53%	15,97%
2008	4,79%	6,95%	0,55%	-0,07%	2,62%	-1,05%	-4,11%	6,71%	-0,04%	6,48%	1,10%	1,66%	27,99%
2009	-1,09%	-0,24%	-4,96%	-4,87%	6,93%	-0,59%	0,56%	-0,13%	0,65%	-3,40%	3,63%	-3,48%	-7,38%
2010	-2,21%	-0,80%	0,45%	-0,57%	0,98%	1,16%	-1,33%	5,13%	0,96%	2,37%	-3,99%	5,25%	7,22%
2011	-3,00%	1,18%	-3,96%	2,66%	-4,23%	-2,89%	4,81%	2,88%	2,67%	-7,54%	-1,85%	0,36%	-9,27%
2012	-0,76%	1,37%	-3,35%	0,80%	4,90%	-5,49%	6,54%	-1,47%	-2,97%	-5,05%	-0,51%	1,55%	-5,04%
2013	-0,82%	-0,88%	1,12%	4,47%	-1,84%	-3,13%	-2,90%	-2,28%	-1,16%	2,05%	4,44%	1,33%	0,03%
2014	-3,14%	4,37%	-3,52%	-0,93%	3,05%	2,88%	-0,14%	6,17%	3,48%	0,98%	8,40%	2,42%	26,00%
2015	6,16%	1,52%	-0,17%	-3,19%	0,12%	-7,02%	-1,33%	-1,59%	2,08%	-5,05%	1,52%	-3,67%	-10,77%
2016	11,23%	5,51%	-3,68%	-0,38%	-3,29%	8,03%	1,74%	-3,71%	-5,29%	-4,73%	5,98%	3,90%	14,51%
2017	-3,11%	6,54%	-0,80%	2,92%	3,05%	-0,69%	3,74%	0,28%	-1,40%	4,34%	0,87%	0,59%	17,11%
2018	8,56%	-5,01%	-4,61%	-2,78%	-0,85%	-1,47%	-0,03%	3,77%	-2,39%	2,06%	-4,79%	0,42%	-7,69%
2019	-3,29%	-2,88%	6,71%	0,58%	8,72%	1,07%	5,09%	2,47%	-0,44%	-2,69%	0,83%	-0,96%	15,42%
2020	2,91%	2,42%	3,51%	0,74%	-1,69%	-0,17%	4,03%	-0,99%	-5,90%				4,54%

La performance affichée avant juillet 2011 est celle du FCIMT Cyril Systematic ajustée pour le risque actuel et une structure de frais de 2% de frais de gestion et 20% de frais de performance. Après juillet 2011, le tableau ci-dessus reflète la performance réalisée ajustée des frais appliqués sur la période.

Les frais de gestion de la Part I ont été réduits le 1er janvier 2018 de 2% à 1,5%.



Sources: John Locke Investments, Société Générale, MSCI Barra.

Information du fonds

Date de lancement du fonds FCIMT	3 juillet 2000
Transformation en fonds UCITS	28 juin 2011
Région	Global
SRRI (Risque DICI)	5/7
ISIN	FR0000976342
Bloomberg	CYRSYST FP
Investissement min.	EUR 500.000
Frais de gestion	1.5%
Frais de performance	20% au-dessus EONIA

Source: John Locke Investments.

Données statistiques au 30 septembre 2020

Performances		Risque	
Rendement net annualisé	+6,73%	Volatilité annualisée	13,97%
Performance depuis le lancement	+273,90%	Dépôt de garantie	11,89%
MSCI World AC EUR	+40,44%	Ratio de Sharpe (0%)	+0,48
Meilleure performance mensuelle	+16,24%	Round A/R traités par million de \$ par an	1250
Plus mauvaise performance mensuelle	-9,69%	Corrélations	
% de mois positifs	53,09%	EuroStoxx 50	-0,20
Drawdown maximum	-20,75%	MSCI World AC EUR	-0,19
12 derniers mois	+1,59%	SG CTA Index	+0,65

Sources: John Locke Investments, DJ EuroStoxx, MSCI Barra, Société Générale.

Sauf indication contraire, toutes les données publiées ci-dessus sont calculées depuis le lancement du fonds.

CONDITIONS GÉNÉRALES		OBLIGATIONS		TAUX CT		DEVISES		ACTIONS	
Structure légale	UCITS								
Domicile	France	38 av. Franklin Roosevelt							
Devise	Euro	77210 Fontainebleau-Avon, France							
Dépositaire	CACEIS Bank	Registered with the AMF N° GP04000064							
Administrateur	CACEIS Fund Administration	CFTC and NFA registered, AIMA member							
Commissaire aux comptes	Deloitte et Associés								

www.jl-investments.com

☎ +33 1 64 70 40 40 // +33 1 64 70 40 34
✉ info@jl-investments.com

Ce document a été écrit par la société John Locke Investments SA. Il ne constitue pas une recommandation d'achat ou de vente d'instruments financiers. Les investissements dans Cyril Systematic doivent être considérés comme des investissements spéculatifs et ne sont potentiellement pas appropriés pour tout type d'investisseurs. Ce fonds est réservé aux clients professionnels au sens de la Directive MIF II. Les investisseurs potentiels doivent effectuer leur propre analyse des risques qu'un tel investissement comporte, y compris le risque de perte substantielle d'une partie ou de la totalité du capital investi. Ce document ne constitue pas une offre de vente ou d'achat et n'a pas de valeur contractuelle. Les informations financières qui ne proviennent pas de John Locke Investments SA contenues dans le présent document sont issues de sources considérées comme sûres, mais ne pouvant néanmoins être garanties.

*Les performances passées ne sont pas une garantie des performances futures.
Le produit présente un risque de perte en capital.*