



Valeur liquidative : 1 021.72 €



Cyriaque DAILLAND



François FONTAINE

Stratégie d'investissement :

Le fonds Sanso MultiStratégies a pour objectif de réaliser sur l'horizon de placement recommandé (5 ans) une performance nette de frais, supérieure à son indice de référence (€STR capitalisé +1,80%).

Le fonds est composé de stratégies complémentaires déployées sur différentes classes d'actifs (actions, taux, crédit, devises...) et zones géographiques (Europe, Etats-Unis, Japon, Emergents...). Le fonds peut prendre des positions acheteuses ou vendeuses sur les diverses classes d'actifs.

Les stratégies peuvent être de différents types : suivi de tendance ; contrariante ; stratégie neutre marché ; rendement... En fonction des configurations de marché, les stratégies peuvent être actives ou inactives. L'allocation entre les différentes stratégies est gérée de façon dynamique.

* Important : La politique de gestion du fonds a été modifiée au 25/08/2020. Le fonds est désormais géré dans une approche Multi-Stratégies avec une mesure des risques en Value At Risk (Var).

SRI :

Risque plus faible

Risque plus élevé



Rendement potentiellement plus faible

Rendement potentiellement plus élevé

Date de création : 25/08/2020

Devise : EUR

Nature juridique : FCP de droit français - OPCVM

Durée d'investissement conseillée : 5 ans

Dépositaire : Caceis bank

Valorisateur : Caceis FA

Commissaire aux comptes : DELOITTE & ASSOCIES

Actif net du fonds : 27.41 M €

Indice de référence : €STR Capitalisé +1.8% Annuel

Fréquence de valorisation : Quotidien

Centralisation : 10h00 en J

Règlement : J+2

Affectation des résultats : Capitalisation

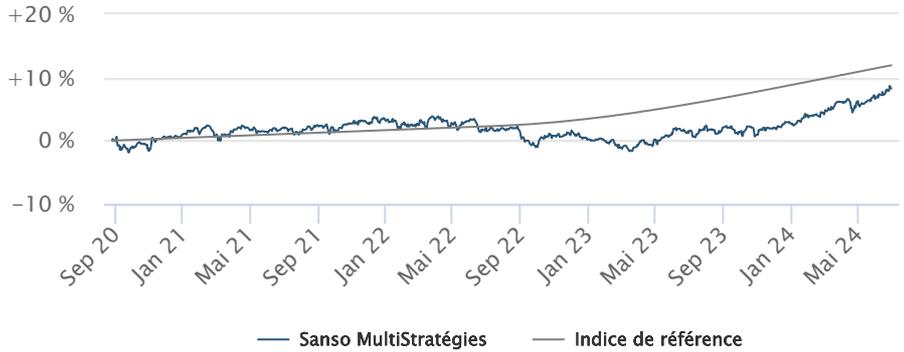
Frais de gestion financière et administratifs : 2.05 %

Commissions de surperformance : 20% TTC si la performance annuelle est supérieure à Ester +1.8% Annuel

Commissions de souscription : 2 % max

Commissions de rachat : Néant

Evolution de la performance depuis 5 ans ou création *



Performances *

| | Jun | 2024 | 1 an | 3 ans | 5 ans | Depuis création | Annualisée depuis création |
|------------------------------|-------|-------|-------|--------|-------|-----------------|----------------------------|
| Sanso MultiStratégies | 1.41% | 5.36% | 6.95% | 6.10% | | 8.23% | 2.08% |
| Indice de référence | 0.43% | 2.89% | 5.81% | 10.78% | | 11.92% | 2.97% |

Historique des performances mensuelles

| Année | Jan. | Fev. | Mars | Avril | Mai | Juin | Juil. | Août | Sept. | Oct. | Nov. | Déc. | Fonds | Benchmark |
|-------|--------|--------|-------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|-------|--------|--------|-----------|
| 2024 | 0.90% | 0.78% | 1.58% | -0.45% | 1.04% | 1.41% | | | | | | | 5.36% | 2.89% |
| 2023 | -0.27% | -1.13% | 0.64% | 0.75% | 0.93% | 0.40% | 0.87% | -0.26% | -0.81% | -0.35% | 1.02% | 0.74% | 2.52% | 5.14% |
| 2022 | -0.48% | -0.21% | 1.02% | -0.77% | 0.55% | -1.54% | 0.38% | -1.33% | -1.67% | 1.81% | 0.86% | -1.40% | -2.83% | 1.78% |
| 2021 | -0.04% | -0.47% | 0.95% | 0.11% | -0.22% | 0.71% | -0.84% | 1.16% | -1.03% | 1.32% | 0.09% | 0.32% | 2.04% | 1.22% |
| 2020 | | | | | | | | -0.10% | -1.02% | -0.55% | 2.13% | 0.60% | 1.05% | 0.43% |

Indicateur de risque (1 an)

| | Fonds |
|-------------------|---------|
| Sharpe | 0.74 |
| Volatilité | 4.09% |
| Drawdown | - 2.03% |

Source: SANSO INVESTMENT SOLUTIONS | Données arrêtées au 28/06/2024.

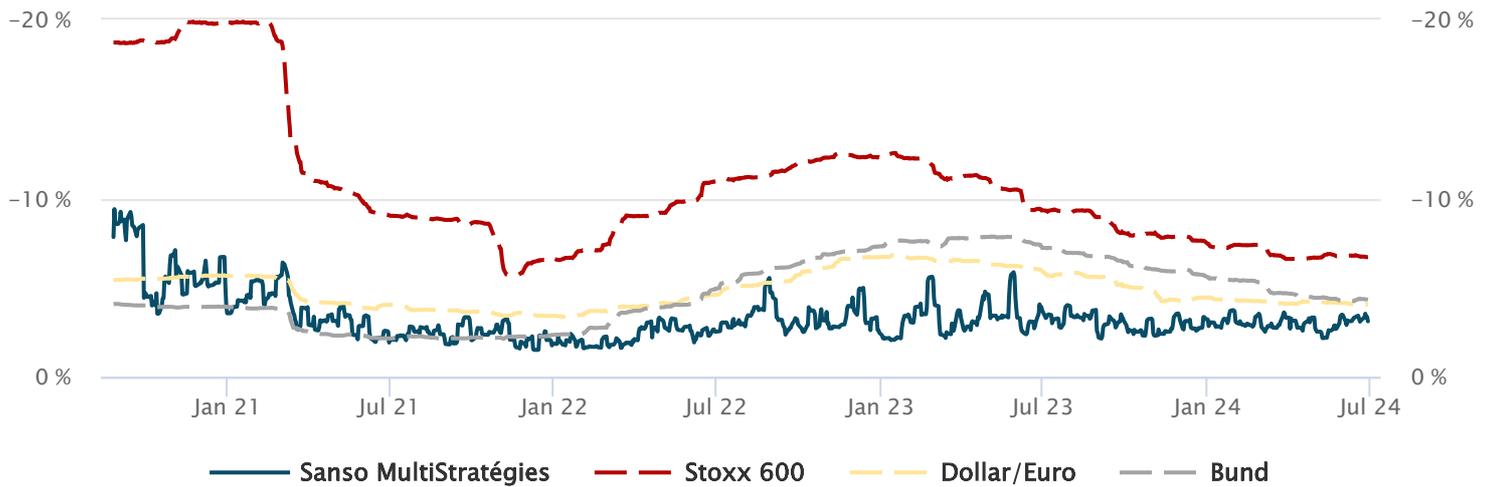
Contact commercial | equipe.commerciale@sanso-is.com | 01.81.22.29.77

Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures.



Evolution du risque porté par le portefeuille

Evolution de la Value at Risk (99%, 20 jours)



La Value at Risk (VaR) est définie comme la perte maximale potentielle qui ne devrait être atteinte qu'avec une probabilité de 99% sur un horizon de vingt jours. La période d'observation est d'une année.

Analyse par famille de stratégies



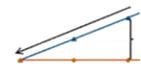
Directionnel

Ces stratégies sélectionnent de manière opportuniste certaines classes d'actifs (actions, taux et devises). Cette famille de stratégie est vendeuse ou acheteuse en fonction des configurations de marchés.



Arbitrage

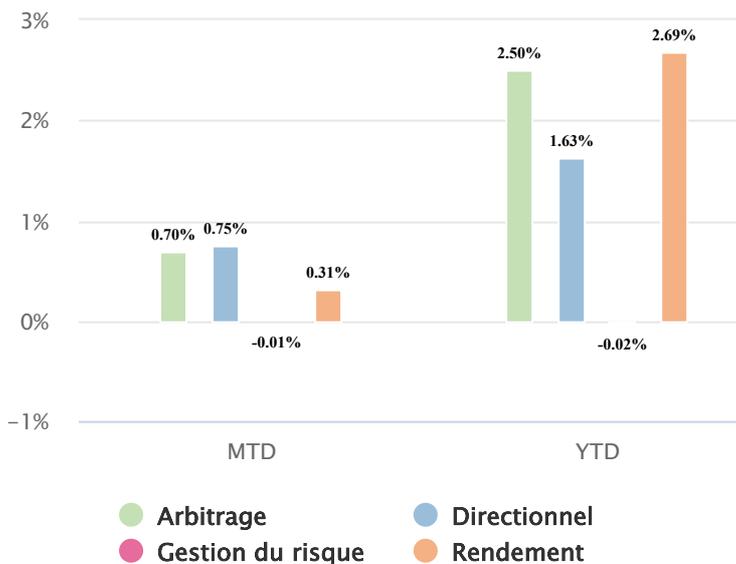
Ces stratégies cherchent à profiter de certaines inefficiences des marchés financiers. Toutes les stratégies de cette famille ont un niveau de corrélation relativement faible vis-à-vis des actifs financiers.



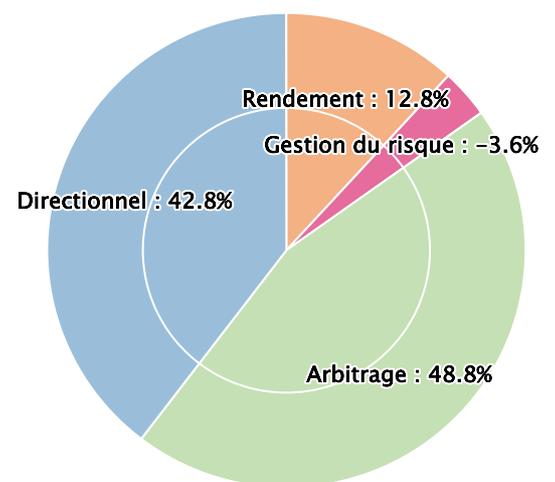
Rendement

Ces stratégies ambitionnent d'investir sur des actifs dont le prix actuel converge vers un prix cible. Cette famille peut investir sur le crédit, les actions liées à des opérations spéciales ou encore sur la volatilité.

Contribution à la performance brute



Contribution à la VaR



Avertissement / Contact

Les informations contenues dans ce document sont remises uniquement à titre d'information et ne sauraient constituer une information contractuelle ou légale. Ce document a pour but de vous informer de manière simplifiée sur les caractéristiques du fonds et de vous permettre d'apprécier le contexte de marché dans lequel le FCP a été géré. Les performances et réalisations passées ne constituent en rien une garantie pour les performances futures. Le prospectus du fonds est disponible sur le site www.sanso-is.com ou sur simple demande auprès de SANSO IS.

Sanso Investment Solutions - SAS au capital de 563 673 € - N° SIREN 535 108 369 RCS Paris - 17, rue Chaillot 75016 Paris - www.sanso-is.com.

Société de gestion agréée par l'AMF sous le n° GP-11000033 - N°ORIAS : 12066196.