



Valeur liquidative : 1 126.36 €



Cyriaque DAILLAND



François FONTAINE

**Stratégie d'investissement :**

Le fonds Sanso MultiStratégies vise sur l'horizon de placement recommandé (5 ans) une performance nette de frais, supérieure à son indice de référence (€STR capitalisé +3% annuel).

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

Devises : 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 + 3% Annuel

Fréquence de valorisation : Quotidien

Centralisation : 10h00 en J

Règlement : J+2

Affectation des résultats : Capitalisation

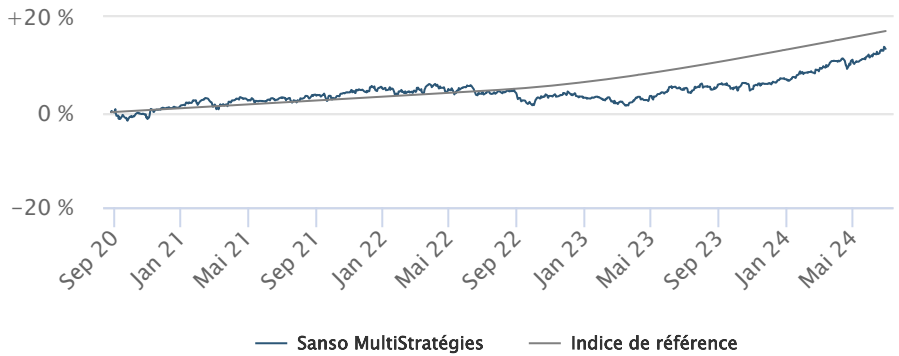
Frais de gestion financière et administratifs : 0.85 %

Commissions de surperformance : 10% TTC si la performance annuelle est supérieure à Ester + 3% Annuel

Commissions de souscription : 2 % max

Commissions de rachat : Néant

Evolution de la performance depuis 5 ans ou création \*



Performances \*

	Juin	2024	1 an	3 ans	5 ans	Depuis création	Annualisée depuis création
<b>Sanso MultiStratégies</b>	1.50%	5.99%	8.24%	9.99%		13.33%	3.31%
<b>Indice de référence</b>	0.52%	3.50%	7.06%	14.75%		17.07%	4.19%

Historique des performances mensuelles

Année	Jan.	Fev.	Mars	Avril	Mai	Juin	Juil.	Août	Sept.	Oct.	Nov.	Déc.	Fonds	Benchmark
2024	1.01%	0.87%	1.67%	-0.34%	1.14%	1.50%							5.99%	3.50%
2023	-0.17%	-1.04%	0.74%	0.84%	1.04%	0.50%	0.97%	-0.16%	-0.71%	-0.24%	1.12%	0.84%	3.76%	6.37%
2022	-0.43%	-0.12%	1.17%	-0.72%	0.66%	-1.45%	0.51%	-1.27%	-1.57%	1.91%	0.93%	-1.26%	-1.70%	2.97%
2021	0.05%	-0.38%	1.06%	0.21%	-0.12%	0.81%	-0.75%	1.27%	-0.95%	1.44%	0.19%	0.45%	3.32%	2.41%
2020								-0.08%	-0.92%	-0.45%	2.24%	0.70%	1.47%	0.84%

Indicateur de risque (1 an)

	Fonds
<b>Sharpe</b>	1.05
<b>Volatilité</b>	4.09%
<b>Drawdown</b>	- 2.00%

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

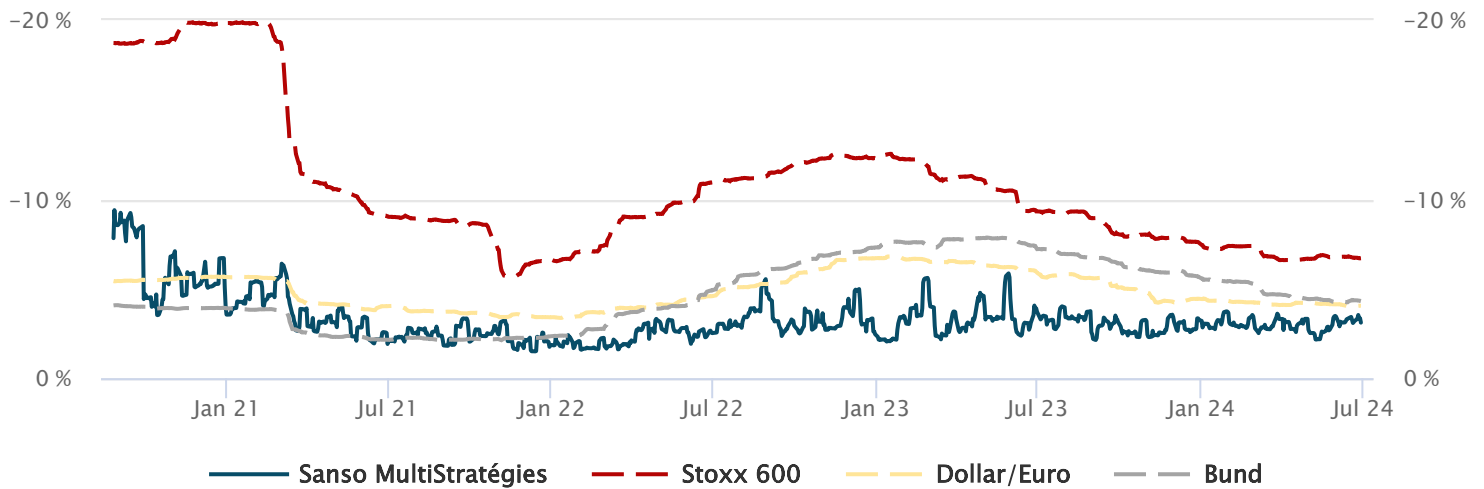
Contact commercial | equipe.commerciale@sanso-is.com | 01.81.22.29.77

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



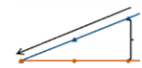
### Directionnel

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

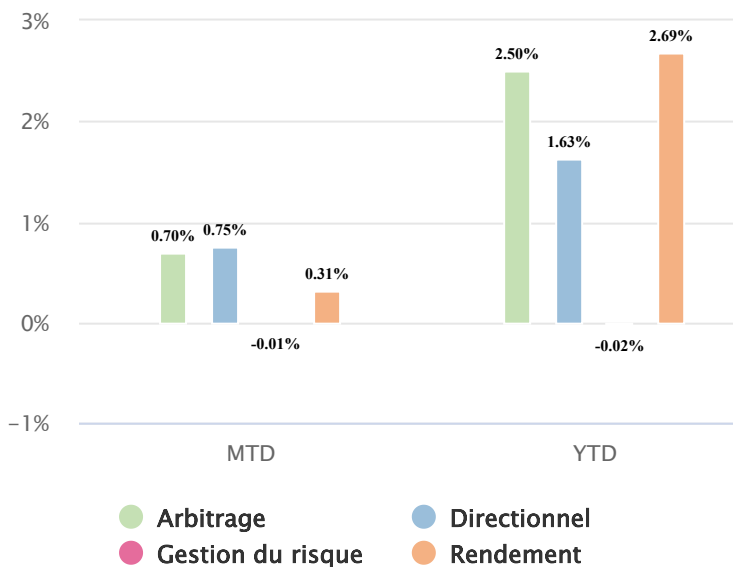
Ces stratégies cherchent à profiter de certaines inefficiences des marchés financiers. Toutes les stratégies de cette famille ont un niveau de corrélation relativement faible vis-à-vis des actifs financiers.



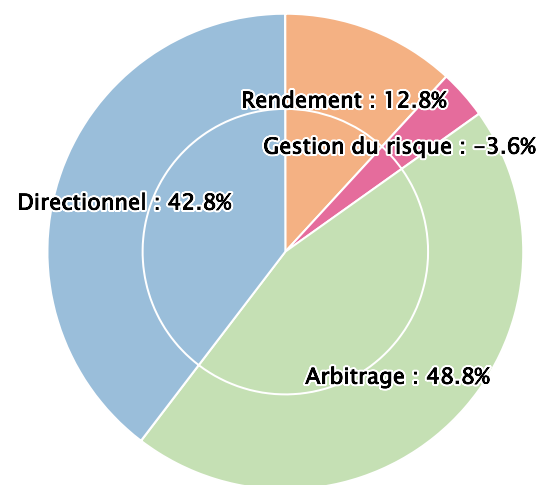
### Rendement

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](http://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](http://www.sanso-is.com).

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