Reporting Octobre 2023
FR0010917229 - Part C

Maxima

Valeur liquidative : 160.66 $

Michel MENIGOZ

François FONTAINE

Stratégie d'investissement :

Maxima est un fonds commun de placement éligible au PEA dont l'objectif est d'obtenir une performance annualisée supérieure à 6% sur un horizon de placement minimum de cinq ans en s'exposant aux marchés de la zone Euro.
La politique d'investissement de l'OPCVM met en œuvre une gestion active et discrétionnaire qui combine plusieurs moteurs de performance.
- Les actions sont sélectionnées selon une approche quantitative. Elles représentent un minimum de 90% de l'actif net du portefeuille.
- Des stratégies complémentaires sont aussi mises en place pour exposer le portefeuille à des thématiques spécifiques.
- Une gestion de l'exposition au risque actions est mise en œuvre sur le portefeuille afin d'ajuster l'exposition dans une fourchette variant entre 70 et 130% de l'actif net.
L'indice Eurostoxx50 est l'indicateur de référence de Maxima. Il pourra servir à l'appréciation de la performance du fonds à posteriori.

SRI :

Risque plus faible — Risque plus élevé

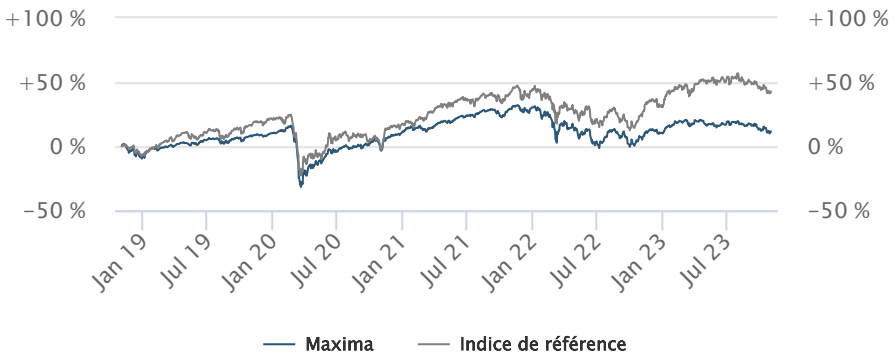
Rendement potentiellement plus faible — Rendement potentiellement plus élevé

Date de création : 27/07/2010
Devise : USD
Nature juridique : FCP de droit francais - OPCVM
Durée d'investissement conseillée : 5 ans
Dépositaire : Caceis bank
Valorisateur : CACEIS FA
Commissaire aux comptes : DELOITTE & ASSOCIES

Actif net du fonds : 12.18 M €
Indice de référence : Eurostoxx 50 (Dividendes Réinvestis)
Fréquence de valorisation : Quotidien
Centralisation : 10h00 en J
Règlement : J+2
Affectation des résultats : Capitalisation

Frais de gestion financière et administratifs : 2 %
Commissions de surperformance : 20% TTC de la performance au-delà d'une performance annuelle nette de 6%
Commissions de souscription : 2 % max
Commissions de rachat : Néant
Eligible au PEA: Oui

Evolution de la performance depuis 5 ans ou création



Performances

	Octobre	2023	1 an	3 ans	5 ans	Depuis création *	Annualisée depuis création*
Maxima	-1.96%	1.59%	4.44%	15.82%	11.65%	38.87%	3.61%
Indice de référence	-2.65%	9.62%	14.06%	47.07%	42.83%	63.38%	5.45%

** Performance depuis la reprise de gestion au 31/07/2014*

Historique des performances mensuelles

Année	Jan.	Fev.	Mars	Avril	Mai	Juin	Juil.	Août	Sept.	Oct	Nov.	Déc.	Fonds	Benchmark
2023	6.09%	2.50%	0.83%	-2.73%	-2.24%	4.15%	0.20%	-1.95%	-2.86%	-1.96%			**1.59%**	**9.62%**
2022	-4.09%	-5.57%	-0.49%	-2.47%	-1.59%	-10.10%	9.93%	-3.23%	-6.40%	6.00%	5.55%	-2.61%	**-15.63%**	**-9.49%**
2021	1.29%	0.07%	3.18%	2.34%	2.23%	1.55%	1.40%	2.21%	-3.53%	4.41%	-1.36%	2.43%	**17.18%**	**23.34%**
2020	1.19%	-6.90%	-22.04%	8.15%	7.31%	2.42%	1.68%	2.42%	2.20%	-5.77%	12.41%	2.59%	**0.96%**	**-3.21%**
2019	6.29%	0.54%	1.28%	2.25%	-1.63%	4.16%	0.23%	-0.90%	2.27%	0.74%	1.16%	1.20%	**18.80%**	**28.20%**
2018	4.75%	-3.38%	-1.56%	4.50%	-0.95%	0.27%	2.83%	-0.34%	-0.23%	-7.22%	-3.15%	-4.30%	**-9.09%**	**-12.03%**

Indicateur de risque (1 an)

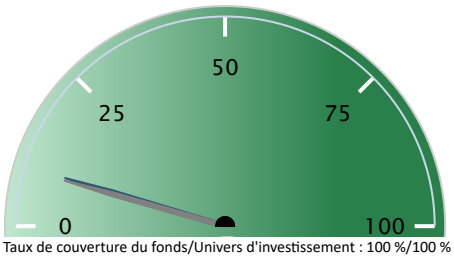
	Fonds	Indice de référence
Sharpe	0.14	0.71
Volatilité	11.35%	15.87%
Drawdown	- 8.83%	- 10.08%
Tracking error	6.69%	
Beta	0.66	

Source: SANSO INVESTMENT SOLUTIONS | Données arrêtées au 31/10/2023.
Contact commercial | equipe.commerciale@sanso-is.com | 01.81.22.29.77
Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures.

Données extra-financières

Exposition aux Objectifs de Développement Durable

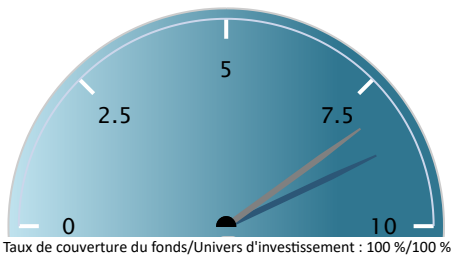
Fonds : 9.3%
Univers d'investissement : 8.8%



Taux de couverture du fonds/Univers d'investissement : 100 %/100 %

Note Environnement, Social & Gouvernance

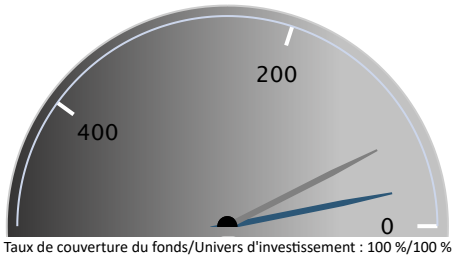
Fonds : 8.6
Univers d'investissement : 8.0



Taux de couverture du fonds/Univers d'investissement : 100 %/100 %

Empreinte Carbone

Fonds : 31.4
Univers d'investissement : 74.8

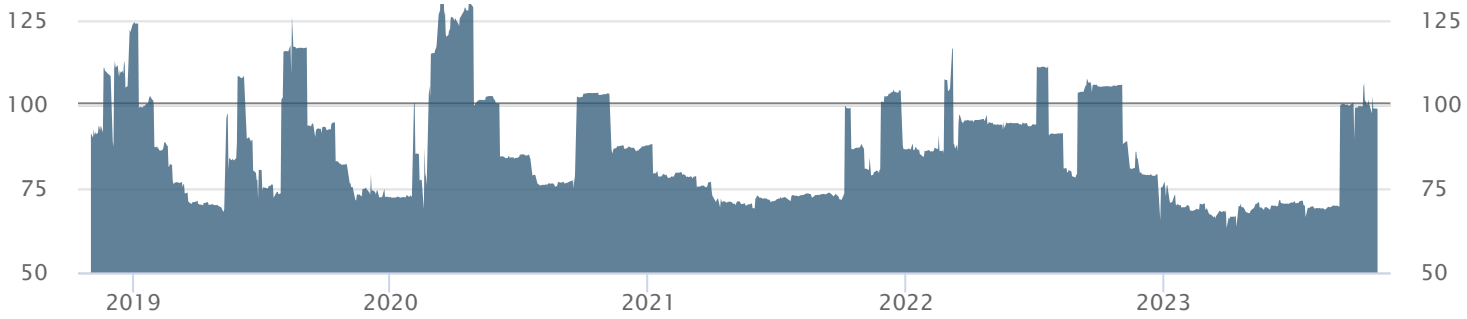


Taux de couverture du fonds/Univers d'investissement : 100 %/100 %

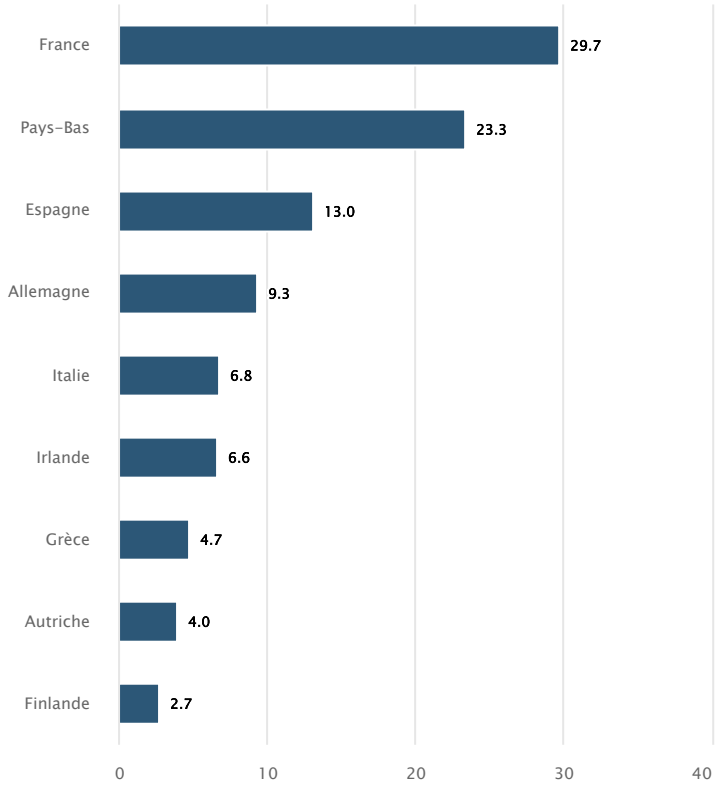
Exposition aux ODD : pourcentage du chiffre d'affaires des entreprises réalisé sur des métiers facilitant l'atteinte des 17 Objectifs de Développement Durable des Nations-Unies.
Note ESG : note comprise entre 0 et 10 se basant sur l'examen des politiques et pratiques Environnementales Sociales et de Gouvernance (ESG) des entreprises. La note est établie relativement aux entreprises du même secteur.
Empreinte carbone : ratio tonnes équivalent CO2/millions de dollar de chiffre d'affaires reflétant l'intensité en termes de gaz à effet de serre de l'activité des entreprises. Les émissions directes et les émissions indirectes liées à la consommation d'énergie (dites scope 1 et 2) sont prises en compte.
Ces métriques reflètent la performance extra-financière du fonds sur la partie investie en titres vifs.

Positionnement du portefeuille

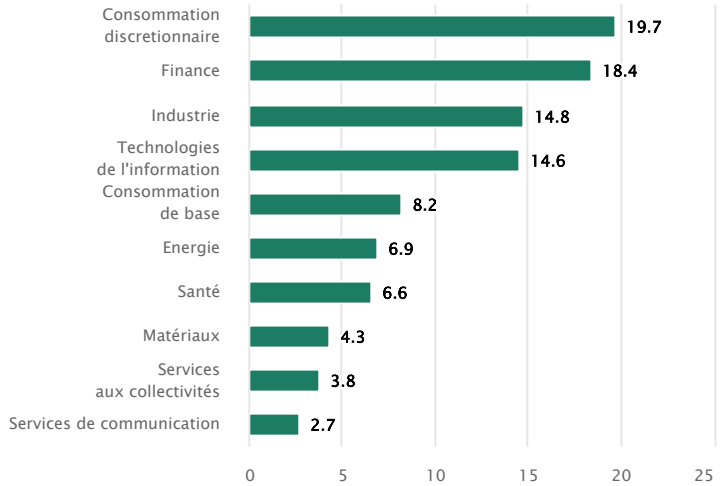
Evolution de l'exposition actions (%)



Ventilation par pays (Poche actions) (%)



Ventilation par secteur (Poche actions) (%)



Les 5 principales positions

ASML HOLDING NV	8.8 %
TECHNIP ENERGIES BV	6.8 %
WOLTERS KLUWER	6.5 %
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	5.6 %
LOREAL	5.5 %
Nombre de lignes :	**28**

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 - 69, Boulevard Malesherbes 75008 Paris - www.sanso-is.com.
Société de gestion agréée par l'AMF sous le n° GP-11000033 - N°ORIAS : 12066196.