

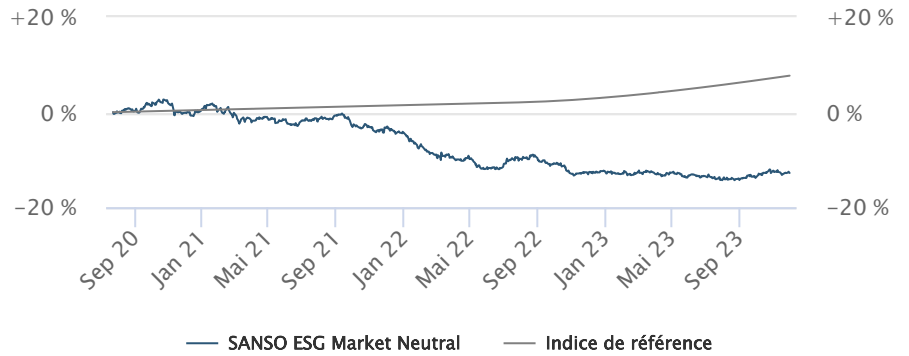


François FONTAINE



Michel MENIGOZ

### Evolution de la performance depuis 5 ans ou création



### Performances

|                                 | Novembre | 2023   | 1 an   | 3 ans   | 5 ans | Depuis création | Annualisée depuis création |
|---------------------------------|----------|--------|--------|---------|-------|-----------------|----------------------------|
| <b>SANSO ESG Market Neutral</b> | -0.55%   | -0.47% | -0.10% | -12.71% |       | -12.80%         | -4.00%                     |
| <b>Indice de référence</b>      | 0.46%    | 4.47%  | 4.73%  | 7.29%   |       | 7.68%           | 2.23%                      |

### Historique des performances mensuelles

| Année | Jan.   | Fev.   | Mars   | Avril  | Mai    | Juin   | Juil.  | Août   | Sept.  | Oct    | Nov.   | Déc.   | Fonds  | Benchmark |
|-------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|-----------|
| 2023  | -0.57% | 0.21%  | -0.30% | 0.28%  | -0.66% | -0.19% | -0.98% | 0.02%  | 0.52%  | 1.77%  | -0.55% |        | -0.47% | 4.47%     |
| 2022  | -2.50% | -2.34% | -0.83% | -0.23% | -1.86% | 0.73%  | 1.21%  | -0.32% | -0.78% | -2.41% | -0.13% | 0.81%  | -8.41% | 1.58%     |
| 2021  | -0.22% | -0.56% | -1.80% | 0.30%  | 0.15%  | -0.28% | 0.25%  | 0.91%  | -2.23% | -0.34% | 0.06%  | -1.28% | -4.97% | 1.02%     |
| 2020  |        |        |        |        |        |        | -0.10% | 0.34%  | 1.01%  | 0.62%  | -1.94% | 0.76%  | 0.66%  | 0.46%     |

### Indicateur de risque (1 an)

|                   | Fonds   |
|-------------------|---------|
| <b>Sharpe</b>     | -1.22   |
| <b>Volatilité</b> | 2.61%   |
| <b>Drawdown</b>   | - 2.35% |

#### Stratégie d'investissement :

L'objectif du FCP est d'obtenir sur la durée de placement recommandée – 5 ans et plus – une performance absolue décorrélée des marchés d'actions – après prise en compte des frais courants – supérieure à celle de l'indicateur de référence soit l'indice €STR +1.6%.

Le portefeuille est composé d'actions de la zone Euro jusqu'à 100% de l'actif net (110% en cas de recours à l'emprunt d'espèces). Le FCP utilise également des instruments dérivés, notamment des contrats futures afin de couvrir l'exposition du fonds au risque de marché 'actions'.

L'exposition actions résultant des investissements en actions directes et en instruments dérivés pourra varier entre -10% et +20% de l'actif net.

Le choix des valeurs composant le portefeuille est discrétionnaire et basé essentiellement sur des critères extra-financiers « ESG » (Environnement, Social, Gouvernance)

#### SRI :

Risque plus faible

Risque plus élevé



Rendement potentiellement plus faible

Rendement potentiellement plus élevé

Date de création : 22/07/2020

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 : 0.99 M €

Indice de référence : €STR +1.6% Index

Fréquence de valorisation : Quotidien

Centralisation : 10h en J

Règlement : J+2

Affectation des résultats : Capitalisation

Frais de gestion financière et administratifs : 0.8 %

Commissions de surperformance : En cas de performance positive, 10% TTC de la surperformance du fonds par rapport à l'indicateur de référence, avec High Water Mark

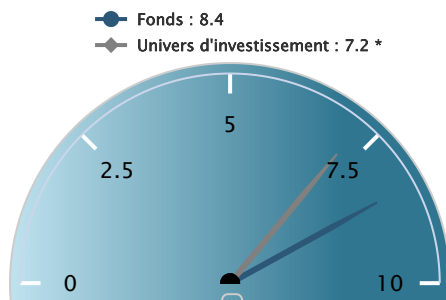
Commissions de souscription : 2 % max

Commissions de rachat : Néant

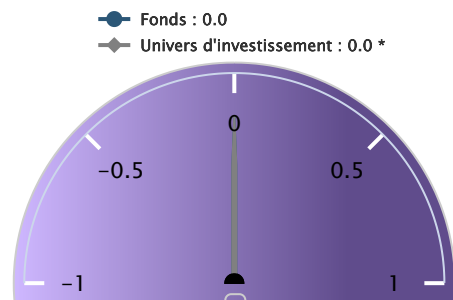
Eligible au PEA: Oui

## Données extra-financières

### Note Environnement, Social & Gouvernance



### Dynamique de la note ESG

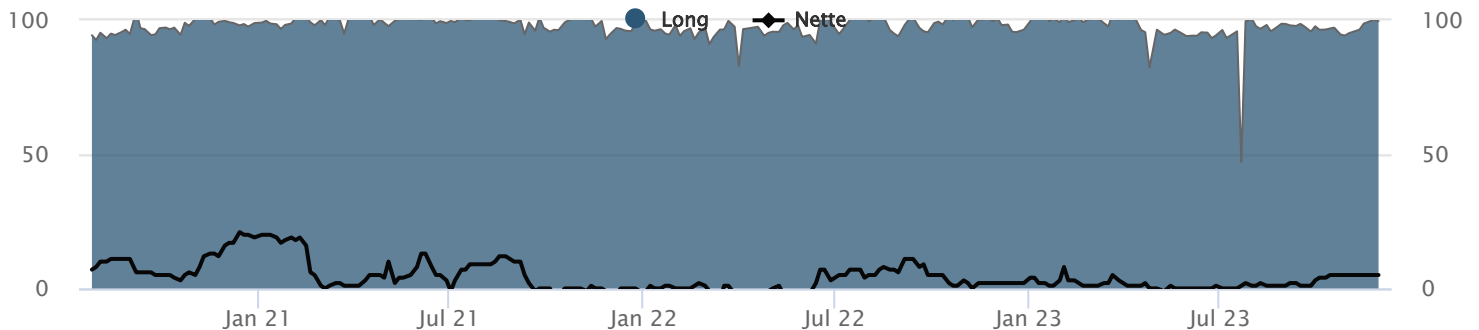


**Note ESG** : note comprise entre 0 et 10 se basant sur l'examen des politiques et pratiques Environnementales Sociales et de Gouvernance (ESG) des entreprises. La note est établie relativement aux entreprises du même secteur.

\* **Univers d'investissement** : Moyenne arithmétique des titres notés

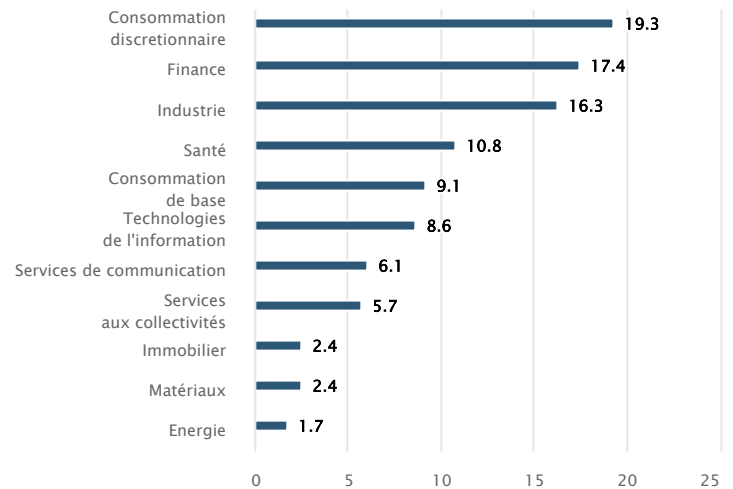
## Positionnement du portefeuille

### Evolution de l'exposition actions



### Ventilation par capitalisation (Poche actions) (%)

### Ventilation par secteur (Poche actions) (%)



### Les 5 principales positions

|                              |           |
|------------------------------|-----------|
| WOLTERS KLUWER               | 7.0 %     |
| LOREAL                       | 6.8 %     |
| HERMES INTL ACT.             | 6.4 %     |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | 6.0 %     |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | 5.0 %     |
| <b>Nombre de lignes :</b>    | <b>34</b> |

## 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 - 69, Boulevard Malesherbes 75008 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.