

#### Information Clés pour l'Investisseur

Ce document fournit des informations essentielles aux investisseurs de cet OPCVM. Il ne s'agit pas d'un document promotionnel. Les informations qu'il contient vous sont fournies conformément à une obligation légale, afin de vous aider à comprendre en quoi consiste un investissement dans ce fonds et quels risques y sont associés. Il vous est conseillé de le lire pour décider en connaissance de cause d'investir ou non.

## SANSO ESG Market Neutral- Part F - EUR (FR0013505781)

OPCVM géré par Sanso Investment Solutions

### Objectifs et politique 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 +1,90%.

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) afin de capter la prime ESG, tendance qui se dessine depuis quelques années sur les marchés d'actions européens et qui pourrait se traduire par une surperformance des titres les mieux positionnés sur ces critères (exemple l'indice MSCI EMU SRI par rapport à l'indice générique MSCI EMU). La SGP a la conviction que les titres des émetteurs les mieux notés d'un point de vue extra financier sont plus performants d'un point de vue financier. Cette conviction est propre à la SGP et ne constitue aucunement une garantie. Le portefeuille sera exclusivement composé de titres appartenant à la zone euro, faisant l'objet d'une notation ESG par MSCI ESG Research, et aucun de ces titres n'aura une notation faisant partie des 20% plus mauvaises notations de son secteur. Une analyse extra-financière est basée sur des critères ESG. A titre indicatif, les critères ESG sont la consommation d'énergie et l'émission de gaz à effet de serre pour la dimension environnementale, les droits de l'Homme, la santé ou la sécurité pour la dimension sociale, ou encore la politique de rémunération et l'éthique globale pour la dimension de la gouvernance. L'analyse extra-financière aboutit à une notation ESG de chaque émetteur sur une échelle allant 0 à 10 (pour MSCI ESG Research).

Le fournisseur actuel utilisé pour la notation ESG des titres est MSCI ESG Research. Cette notation ESG relative par secteur, obtenue selon la méthodologie de MSCI ESG, est initialement calculée pour l'ensemble des zones géographiques. Elle est donc recalculée par les équipes de Sanso à partir des notations absolues fournies par MSCI ESG Research, afin d'obtenir un classement d'attractivité extra-financière uniquement pour la zone de l'union monétaire européenne.

Après avoir conservé les 80% des titres les mieux notés au sein de l'univers, la gestion apprécie l'attractivité des titres à partir d'une note qui est la combinaison d'une analyse du positionnement ESG des sociétés dans leur secteur d'activité et de l'amélioration de celle-ci. Le portefeuille est constitué en choisissant de façon discrétionnaire dans chaque secteur d'activité, les grandes, moyennes et petites valeurs les plus attractives ; la gestion s'assure d'une bonne diversification du portefeuille et surtout de l'absence de biais significatifs sectoriels et de tailles de capitalisation. Une analyse complémentaire basée sur des critères financiers quantitatifs (ratios de valorisation, croissance de chiffre d'affaires, profitabilité, révisions bénéficiaires, momentum) permet également de conforter ou d'invalider un choix de valeur établi initialement sur des considérations extra financières..

La société de gestion a classé le fonds en tant que produit financier soumis à l'article 8 du règlement SFDR.

Le FCP, éligible au plan d'épargne en actions (PEA), investit en permanence plus de 75% de son actif net en instruments financiers éligibles eux-mêmes au PEA.

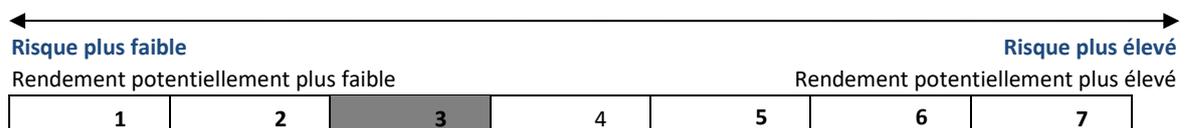
Le FCP peut investir jusqu'à 10% de l'actif net dans des OPCVM et jusqu'à 20% de son actif net en emprunts d'états à court terme afin de gérer les liquidités. La sensibilité de la poche taux du portefeuille est comprise entre 0 et +1. La société de gestion ne recourt pas exclusivement ou mécaniquement aux notations de crédit émises par les agences mais privilégie sa propre analyse. La limite d'engagement global est de 200% de l'actif net. Le fonds n'est pas exposé au risque de change.

Les revenus nets du FCP sont totalement réinvestis.

Les demandes de rachat sont reçues tous les jours jusqu'à 10 heures et exécutées quotidiennement, selon les modalités précisées dans le prospectus.

Cet OPCVM pourrait ne pas convenir aux investisseurs qui prévoient de retirer leur apport avant 5 ans.

### Profil de risque et de rendement :



L'exposition aux risques actions explique le classement de l'OPC dans cette catégorie d'indicateur de risque et de rendement.

La catégorie de risque associée à ce fonds n'est pas garantie et pourra évoluer dans le temps.

La catégorie la plus faible ne signifie pas « sans risque ». Le capital initialement investi ne bénéficie d'aucune garantie.

#### Risques importants pour l'OPC non pris en compte dans l'indicateur :

- ☐ Risque lié aux instruments financiers à terme : il s'agit du risque d'amplification des pertes du fait du recours à des instruments dérivés tels que les contrats financiers – contrats futures et options – pour couvrir le portefeuille.
- ☐ Risque de liquidité : les marchés sur lesquels le FCP intervient peuvent être occasionnellement affectés par un manque de liquidité temporaire. Ces dérèglements de marché peuvent impacter les conditions de prix auxquelles le FCP peut être amené à liquider, initier ou modifier des positions.

La survenance de l'un de ces risques peut faire baisser la valeur liquidative de votre portefeuille

## Frais

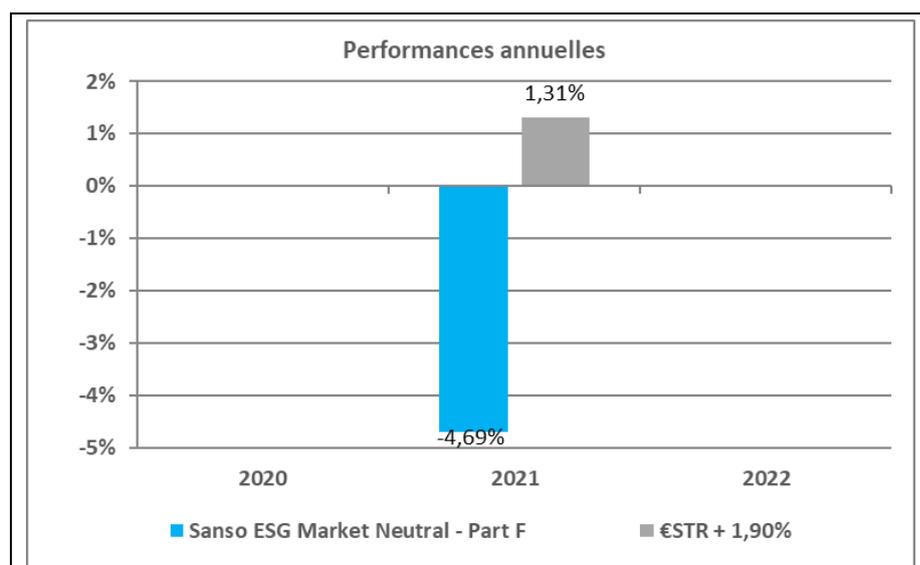
Frais ponctuels prélevés avant ou après investissement	
Frais d'entrée	2% maximum
Frais de sortie	Néant
Le pourcentage indiqué est le maximum pouvant être prélevé sur votre capital en cas de rachat. L'investisseur peut obtenir de son conseil ou de son distributeur le montant effectif des frais d'entrée et de sortie.	
Frais prélevés par le fonds sur une année	
Frais courants	1.51% TTC (*)
Frais prélevés par le fonds dans certaines circonstances	
Commission de performance	En cas de performance positive, 10% TTC de la surperformance du fonds par rapport à l'indicateur de référence, avec High Water Mark
Dernier exercice	Néant

(\*) Exercice clos au 30/09/2021. Ce pourcentage peut varier d'une année sur l'autre. Pour plus d'information sur les frais, veuillez-vous référer à la page 9 du prospectus de cet OPC, disponible sur le site internet [www.sanso-is.com](http://www.sanso-is.com)

Les frais courants comprennent les frais de gestion financière, les frais administratifs externes (dépositaire, comptable, CAC...), les frais liés au conseil d'investissement, les commissions de mouvement, les frais de gestion indirects. Ils ne comprennent pas les commissions de surperformance et les frais d'intermédiation excepté dans le cas de frais d'entrée et/ou de sortie payés par l'OPC lorsqu'il achète ou vend des parts d'un autre véhicule de gestion collective.

Les frais et commissions acquittés servent à couvrir les coûts d'exploitation de l'OPC y compris les coûts de commercialisation et de distributions des parts, ces frais réduisent la croissance potentielle des investissements

## Performances passées



Ce diagramme ne constitue pas une indication fiable des performances futures.

Les frais courants ainsi que les éventuelles commissions de performance prélevées ont été inclus dans le calcul des performances passées. Les éventuels frais d'entrée ou de sortie n'ont pas été inclus dans le calcul des performances passées.

Date de création du FCP : 22/07/2020.

Devise de calcul des performances passées de l'OPCVM : Euro

## Informations pratiques

Dépositaire : CACEIS Bank

Le prospectus et les derniers documents d'informations périodiques réglementaires, ainsi que toutes autres informations pratiques, sont disponibles gratuitement auprès de la société de gestion, sur simple demande écrite du porteur à Sanso Investment Solutions, 69 boulevard Malesherbes, 75008 Paris ou via son site internet [www.sanso-is.com](http://www.sanso-is.com).

Le FCP dispose également de parts R (EUR, FR0013505740), I (EUR, FR0013505757) et S (EUR, FR0013505765). Le prospectus et les derniers documents d'information périodiques réglementaires de ces parts sont également disponibles dans les mêmes conditions.

La valeur liquidative peut être obtenue auprès de la société de gestion et sur son site Internet.

Selon votre régime fiscal, les plus-values et revenus éventuels liés à la détention de titres de l'OPC peuvent être soumis à imposition. Nous vous conseillons de vous renseigner à ce sujet auprès du commercialisateur de l'OPC et/ou d'un conseiller fiscal.

La politique de rémunération des collaborateurs est disponible sur demande auprès de la société de gestion.

La responsabilité de Sanso Investment Solutions ne peut être engagée que sur la base de déclarations contenues dans le présent document qui seraient trompeuses, inexactes ou non cohérentes avec les parties correspondantes du prospectus de l'OPC.

Ce fonds est agréé en France et réglementé par l'Autorité des Marchés Financiers.

Date d'agrément : 23/06/2020. Numéro d'agrément : FCP20200146

Sanso Investment Solutions est agréée en France par l'Autorité des Marchés Financiers sous le numéro GP-11000033

Les informations clés pour l'investisseur ici fournies sont exactes et à jour au 01/02/2022