COMMUNICATION PUBLICITAIRE

Ceci est une communication publicitaire. Veuillez-vous référer au prospectus du fonds et au document d'informations clés ou document d'informations clés pour investisseur avant de prendre toute décision finale d'investissement.

COMMUNIQUÉ DE PRESSE

ELLIPSIS AM : NOUVEL OBJECTIF DE GESTION POUR SON FONDS « ELLIPSIS OPTIMAL SOLUTIONS - LIQUID ALTERNATIVE »

Paris, le 09 septembre 2023,

Dans la continuité du développement de son offre de solutions d'investissement différenciantes, Ellipsis AM a le plaisir de présenter sa nouvelle stratégie, implémentée au sein du fonds « Ellipsis Optimal Solutions - Liquid Alternative ». L'objectif est d'intégrer l'expertise de gestion Overlay & Customised Solutions d'Ellipsis AM au service d'une allocation sur divers facteurs de risques actions et obligataires. Le fonds vise à proposer un profil de gestion diversifié pour extraire une performance décorrélée des marchés.

La construction du portefeuille est réalisée à travers une gestion active selon une approche systématique, visant à surpondérer l'allocation aux actions et obligations tout en réduisant les risques via une couverture optionnelle systématique optimisée, tout ceci associé à une stratégie de rendement discrétionnaire utilisant des instruments dérivés listés liquides.

La stratégie d'investissement est composée de deux classes d'actifs :

1. **Une poche « actions thématiques »**, principalement investie dans des entreprises visant à réduire leur empreinte carbone ou contribuant à la préservation de la biodiversité. Par construction, cette allocation est naturellement exposée aux facteurs de risque « Qualité » et « Croissance »¹.
2. **Une seconde allocation « tactique »**, proposant une gestion quantitative tournée entre l'univers obligataire ESG Investment Grade et en taux sans risque/liquidités. Le poids de cette poche est variable selon le risque de défaut anticipé.

Une stratégie d'Overlay, pierre angulaire de la construction du fonds complète la gestion et est basée sur deux axes :

1. **Une couverture dynamique « Black Swan »**, composée d'options de couverture dynamique, contribuant à l'encadrement de la baisse maximale du fonds en cas de baisse extrême de marché.
2. **Une stratégie discrétionnaire de rendement** utilisant des instruments dérivés listés liquides, permettant la gestion des risques de la stratégie de couverture systématique.

Ellipsis Optimal Solutions – Liquid Alternative a pour objectif de restituer, sur un horizon de 5 ans, une performance annuelle de 6-8% par an sur l'horizon de placement recommandé, associé à un objectif de volatilité réalisée annuelle de 6% et un objectif de perte maximale de -10%.

Le fonds est classifié article 8 - SFDR².

Pierre GALLICE, Responsable Overlay & Gérants de portefeuille³ ajoute: « Cette stratégie au positionnement unique en Europe est conçue de manière à rechercher une performance robuste dans de nombreux environnements de marché. »

Alexandre RYO, Responsable du pôle Overlay & Customised Solutions : « Nos modèles ont été mis à l'épreuve des marchés sur les 15 dernières années au service d'investisseurs institutionnels Européens. Ellipsis Optimal Solutions – Liquid Alternative intègre toute l'expérience accumulée de notre équipe de gestion. »

Pays d'enregistrement : France / Suisse / Italie / Luxembourg

A propos d'Ellipsis AM

Avec près de 20 ans d'historique de gestion et près de 2,5 milliards d'euros sous gestion (au 31/12/2022), Ellipsis AM est une société de gestion reconnue sur les obligations convertibles européennes et globales. La société a également développé des expertises de gestion spécialisées dans le crédit, la volatilité et les dérivés listés.

A propos du pôle de gestion « Overlay & Customised Solutions »

¹ « qualité » : entreprises ayant une forte rentabilité et un bilan solide / « Croissance » : entreprises à fort potentiel de croissance.

² ESG : Environnement / Social / Gouvernance. SFDR : Règlement européen (UE) No 2019/2088 dit Sustainable Finance Disclosure (SFDR). Plus d'infos sur notre politique ESG (critères environnementaux, sociaux et de gouvernance) : <https://www.ellipsis-am.com/fra/fr/pro/esg-reglementaire>.

³ Équipe de gestion au 30/06/2023 susceptible d'évoluer au cours de la vie d'un fonds.

Fort de **15 ans d'expérience**, l'équipe « Overlay & Customised Solutions » d'Ellipsis AM, s'adresse aux problématiques de portefeuille institutionnel et propose notamment des solutions pour limiter les risques de portefeuille ou améliorer son rendement. L'équipe gère aujourd'hui **1,3 Milliards d'Euro**⁴ à travers plus d'une **dizaine de mandats et de fonds overlay implémentés** et réunit toute son expertise pour lancer sa nouvelle stratégie « Liquid Alternative ».

Contacts presse

Antoine BERGER aberger@keplercheuvreux.com +33 1 70 98 85 55	Vincent MARTIN-DELAHAYE vmartin@keplercheuvreux.com +33 1 70 98 85 04
---	--

Principaux facteurs de risque :

La stratégie mise en œuvre est susceptible de générer une performance négative lors de baisses lentes et continues des actifs risqués ou bien lors de périodes de faibles volatilités. Le fonds est exposé à un risque de modèle lié à la stratégie de couverture mise en œuvre qui repose sur un processus de gestion systématique. Il existe un risque que ce modèle ne soit pas efficient. Par ailleurs, le fonds est exposé à un risque de volatilité, de contrepartie, à un risque lié à l'utilisation d'instruments financiers à terme. Ces différents éléments peuvent entraîner une baisse de la valeur liquidative du fonds, qui ne fait l'objet d'aucune garantie ni protection.

INFORMATIONS IMPORTANTES

Ce document publicitaire est exclusivement conçu à des fins d'information et ne constitue pas un conseil en investissement de produits financiers. Du fait de leur simplification, les informations contenues dans ce document peuvent n'être que partielles. Elles peuvent être subjectives et sont susceptibles d'être modifiées sans préavis. Toutes ces données ont été établies de bonne foi sur la base d'informations de marché. Pour ceux de ces éléments qui proviennent de sources d'information externes, leur exactitude ne saurait être garantie.

L'investissement concerne la souscription de parts d'un placement collectif et non des actifs sous-jacents. Les OPC n'offrent pas de garantie en capital.

L'offre de parts d'OPC peut être limitée ou interdite par la loi dans certaines juridictions. Avant toute proposition, il convient de vérifier dans quels pays le ou les OPC visés dans le présent document sont enregistrés pour la commercialisation. L'OPC ne peut pas être souscrit ou détenu par une Personne Non Eligible ou par un Intermédiaire Non Eligible (cf. rubrique "Souscripteurs concernés" du prospectus).

Ce document ne peut être reproduit sous quelque forme que ce soit ou transmis à une personne autre que celle à qui il est adressé sans l'accord écrit préalable d'Ellipsis AM.

Informations supplémentaires pour la Suisse :

Le pays d'origine du fonds est la France. En Suisse, le représentant est Acolin Fund Services AG, Leutschenbachstrasse 50, CH-8050 Zurich, et l'agent payeur est Banque Cantonale de Genève, quai de l'Île 17, CH-1204 Genève. Le prospectus, les feuilles d'information de base resp. les informations clés pour l'investisseur, le règlement, les rapports annuel et semestriel peuvent être obtenus gratuitement auprès du représentant.

www.ellipsis-am.com

⁴ Données au 30/06/2023.