

Document d'informations clés

LYSIS ESG THEMATICS (Part C)

OBJECTIF

Le présent document contient des informations essentielles sur le produit d'investissement. Il ne s'agit pas d'un document à caractère commercial. Ces informations vous sont fournies conformément à une obligation légale, afin de vous aider à comprendre en quoi consiste ce produit et quels risques, coûts, gains et pertes potentiels y sont associés, et de vous aider à la comparer à d'autres produits.

PRODUIT

Nom du produit : **LYSIS ESG THEMATICS – Part C** (le « Fonds »)
Code ISIN : FR0013531357

Producteur du PRIIP : **Tailor Asset Management** (la « Société de Gestion »), société de gestion française agréée par l'Autorité des Marchés Financiers le 22 juin 1990 sous le numéro GP90031.

Contact : 23 rue Royale – 75008 Paris ; appelez le +33 (0)1.58.18.38.10 pour de plus amples informations ; <https://www.tailor-am.com/>

L'Autorité des Marchés Financiers est chargée du contrôle de Tailor Asset Management en ce qui concerne ce document d'informations clés. Le Fonds a obtenu un agrément de l'Autorité des Marchés Financiers le 27 novembre 2020.

Date de production du Document d'Informations Clés (« DIC ») : 01/03/2023

VOUS ETES SUR LE POINT D'ACHETER UN PRODUIT QUI N'EST PAS SIMPLE ET PEUT ETRE DIFFICILE A COMPRENDRE.

EN QUOI CONSISTE CE PRODUIT ?

Type

Ce produit est un organisme de placement collectif en valeurs mobilières de droit français et constitué sous la forme d'un fonds commun de placement (le « Fonds »). Le Fonds est soumis aux règles applicables aux OPCVM agréés.

Objectifs

Classification AMF : Actions Internationales. L'objectif de gestion de l'OPCVM consiste à rechercher une performance supérieure à l'indicateur de référence MSCI WORLD NR EUR index dividendes réinvestis, sur une durée de placement recommandée supérieure à 5 ans, investissant à hauteur de 90% minimum en OPCVM et/ou FIA ayant le Label ISR français ou respectant eux-mêmes, d'après les vérifications du gérant, les contraintes applicables aux fonds ISR issues de la position-recommandation 2020-03 de l'AMF. Les indices sont retenus en cours de clôture et exprimés en euro, coupons et dividendes réinvestis. La politique d'investissement repose sur une gestion active et discrétionnaire, l'indicateur de référence est utilisé uniquement à titre de comparaison. Le gérant est donc libre de choisir les sous-jacents qui composent le portefeuille dans le respect de la stratégie de gestion est des contraintes d'investissement. L'indicateur de référence sert à déterminer la commission de performance qui pourra être prélevée. Il sert de référence a posteriori. L'objectif sera réalisé en investissant sur des fonds thématiques présentant des perspectives de croissance élevées à long terme selon l'analyse du gérant. Ces thématiques découlant de tendances affectant durablement la société et l'économie par la prise en compte d'aspects environnementaux, sociaux, de droits humains et de gouvernance, le processus de sélection conduira à réaliser une analyse macro-économique permettant de déterminer les thèmes les plus adaptés à la situation politique, économique et financière. Le fonds présente une approche multi-thématiques autour des thématiques telles que la santé et le mode de vie, l'environnement et l'impact, l'énergie renouvelable et l'eau, la technologie et l'intelligence artificielle, données à titre d'exemple (liste non exhaustive et non limitative). Aucune des thématiques d'investissement n'est structurellement privilégiée mais certains choix ponctuels sont réalisés selon les anticipations de la société de gestion de portefeuille. Ainsi, le fonds pourra investir dans des fonds présentant un mixte de thématiques respectant les critères ESG. A cette première analyse s'ajoutera une approche intra-thématique visant à sélectionner les fonds au processus de gestion le plus cohérent et pérenne, selon l'analyse du gérant. Le processus de sélection des sous-jacents intègrera une évaluation des critères ESG. Le gérant utilise un processus développé en six étapes reposant sur un modèle d'aide à la décision développé par la société de gestion basé sur :

1. Détermination de l'univers d'investissement répondant au critère ESG : L'univers est exclusivement composé de fonds ayant obtenu le Label public français ISR ou un label européen équivalent et respecteront, d'après les vérifications du gérant, les contraintes applicables aux fonds ISR issues de la position-recommandation 2020-03 de l'AMF

2. Analyse comparative des fonds, sur les bases de données quantitatives : performances et volatilité des fonds par catégories (géographie et thématiques)

3. Analyse détaillée des fonds sélectionnés : analyse statistique par périodes des fonds incluant notamment les performances, la volatilité, les frais de gestion, le ratio de Sharpe (permet de mesurer la rentabilité d'un portefeuille d'actifs en fonction du risque de ce dernier) et le Max Drawdown (correspond à la perte maximale historique supportée par

un investisseur qui aurait acheté au plus haut et revendu au plus bas pour une période donnée).

4. Analyse de la composition : répartition sectorielle, répartition géographique, répartition par taille de capitalisation, principales lignes du portefeuille (allocation)

5. Confrontation aux fonds similaires : confrontation des fonds d'une même catégorie afin de déterminer le produit affichant les meilleures caractéristiques (Performances, Ratio de Sharpe, Volatilité, Time to Recovery, Max Drawdown, Frais de Gestion, solidité de la structure, encours sous gestion, stabilité de l'équipe, ressources de l'équipe).

6. Audit de l'équipe de gestion : due diligences réalisées sur les fonds retenus afin de s'assurer de la pérennité et de la solidité de l'équipe de gestion (Contrôle DICI/Prospectus, Entretien avec les équipes de gestion, Consultation du questionnaire de Due Diligence).

7. Insertion en portefeuille : Analyse des corrélations entre les fonds et insertion en portefeuille

LYSIS ESG Thematics est un fonds de fonds qui investira exclusivement dans des OPCVM de droit français ou européen (y compris ETF's dans la limite de 50% de l'actif net). Chaque fonds dans lesquels sera investi LYSIS ESG Thematics dispose de sa propre approche pour la prise en compte des critères ESG, y compris en ce qui concerne l'approche des critères relatifs au changement climatique. Par conséquent, il se peut qu'elles ne soient pas totalement cohérentes entre elles. Le FCP s'engage à respecter les fourchettes d'expositions sur l'actif net suivantes :

- De 80% à 100% de l'actif net sur les marchés d'actions, de toutes capitalisations, de tous les secteurs, toutes zones géographiques dont:
 - sur les marchés des pays émergents jusqu'à 30% de l'actif net du fonds
 - sur les marchés des actions de petites (de 500 M€ à 2 Mds € de capitalisation boursière) et moyennes capitalisations (de 2 Mds € à 10 Mds € de capitalisation boursière) jusqu'à 50% de l'actif net du fonds.
 - De 0% à 20% en titres de créance et instruments du marché monétaire sans contraintes de répartition dettes privées/ dettes publiques, de ratings, ni de durée.
 - De 0% à 100% de l'actif net au risque de change sur les devises hors euro.

Le cumul des expositions ne dépasse pas 100% de l'actif.

L'OPCVM investira de manière systématique dans des fonds ayant le label ISR ou respectant eux-mêmes les critères quantitatifs issus de ce label, à savoir une réduction de 20% de leur univers d'investissement après élimination des moins bonnes notations extra-financières ou une note extra-financière supérieure à la note de leur univers d'investissement après élimination de minimum de 20% des valeurs les moins bien notées ainsi qu'un taux d'analyse ou de notation extra-financière supérieur à 90% en nombre d'émetteurs ou en capitalisation de l'actif net du placement collectif.

La part C du FCP capitalise des revenus chaque année. Sa devise de libellé est l'EUR.

Conditions de souscriptions et de rachats

Les ordres de souscription et de rachat sont centralisés chaque jour ouvré à 12 heures (J) par CACEIS BANK et exécutés sur la base de la prochaine valeur liquidative calculée sur les cours de clôture de Bourse du même jour (J). Nous attirons l'attention des investisseurs sur la possibilité de l'existence de délais contractuels supplémentaires propres à leurs intermédiaires financiers pour la centralisation de leurs souscriptions et rachats.

Informations pratiques

Le dépositaire est CACEIS BANK – 89-91 rue Gabriel Péri – 92120, Montrouge. Le souscripteur peut obtenir plus d'informations sur l'OPCVM (prospectus, rapport annuel, rapport semestriel) gratuitement, sur simple demande écrite auprès de Tailor Asset Management – 23 Rue Royale – 75008 PARIS – www.tailor-am.com. Les documents seront uniquement remis en langue française.

Le lieu de publication de la valeur liquidative se situe dans les locaux de la société de gestion et sur le site internet www.tailor-am.com.

Investisseurs de détail visés

Tous investisseurs privés ayant la connaissance et l'expérience requises pour comprendre les caractéristiques et les risques inhérents à la détention d'actions d'un tel fonds, risque élevé dû à l'investissement en actions cotées, recherchant une stratégie dynamique et un rendement sur un placement à moyen ou long terme (5 ans) et capables de supporter des pertes financières. Le montant minimum de première souscription est d'1 part.

Durée du Fonds

La durée minimum de placement recommandée est fixée à 5 années. Ce fonds pourrait ne pas convenir aux investisseurs qui prévoient de retirer leur apport avant cette date.

QUELS SONT LES RISQUES ET QU'EST-CE QUE CELA POURRAIT ME RAPPORTER ?

1	2	3	4	5	6	7
---	---	---	---	---	---	---

Risque le plus faible

Risque le plus élevé



L'indicateur synthétique de risque (« ISR ») permet d'apprécier le niveau de risque de ce produit par rapport à d'autres produits. Il indique la probabilité que ce produit enregistre des pertes en cas de mouvements sur les marchés ou d'une impossibilité de notre part de vous payer.

L'indicateur de risque part de l'hypothèse que vous conservez le produit durant 5 ans, nombre d'années correspondant à la durée minimum de placement recommandée.

Nous avons classé ce produit dans la classe de risque 4 sur 7, qui est une classe de risque moyenne, en raison de son exposition équilibrée et flexible entre actions et instruments de taux. Cette exposition induit des fluctuations et une volatilité de la valeur liquidative.

Les données historiques telles que celles utilisées pour calculer l'indicateur de risque pourraient ne pas constituer une indication fiable du profil de risque futur. 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 ».

Risques pertinents non pris en compte dans cet indicateur :

- Risque de crédit : En cas de dégradation de la qualité des émetteurs, par exemple de leur notation par les agences de notation financière, ou si l'émetteur n'est plus en mesure de les rembourser et de verser à la date contractuelle l'intérêt prévu, la valeur de ces titres peut baisser, entraînant ainsi la baisse de la valeur liquidative de l'OPCVM. Les titres dits « spéculatifs » présentent un risque accru de défaillance et peuvent varier plus fortement.
- Risque de liquidité : Il représente le risque qu'un marché financier, lorsque les volumes d'échanges sont faibles ou en cas de tensions sur ce marché, ne puisse absorber les volumes de ventes (ou d'achats) sans faire baisser (ou monter) significativement le prix des actifs.

SCENARIOS DE PERFORMANCE

Ce que vous obtiendrez de ce Fonds dépend des performances futures du marché. L'évolution future du marché est aléatoire et ne peut être prédite avec précision.

Les scénarios défavorable, intermédiaire et favorable présentés représentent des exemples utilisant les meilleures et pires performances, ainsi que la performance moyenne du Fonds au cours des 5 dernières années.

Le scénario de tensions montre ce que vous pourriez obtenir dans des situations de marché extrêmes.

Période d'investissement recommandée : 5 ans Exemple d'investissement : 10,000€		
Scénarios	Si vous sortez après 1 an	Si vous sortez après 5 ans
Scénario de tension	-45.03%	-15.43%
	5,500€	4,330€
Scénario défavorable	-22.53%	-3.76%
	7,750€	8,260€
Scénario modéré	+7.26%	+9.83%
	10,730€	15,980€
Scénario favorable	+32.66%	+13.04%
	13,270€	18,450€

Ce tableau montre les sommes que vous pourriez obtenir sur 5 ans en fonction de différents scénarios et en supposant que vous investissiez 10'000€. Les différents scénarios montrent comment votre investissement pourrait se comporter. Vous pouvez les comparer avec les scénarios d'autres Fonds. Les scénarios présentés sont une estimation des performances futures à partir de données du passé relatives aux variations de la valeur de cet investissement. Ils ne constituent pas une indication exacte de ce que vous pourriez obtenir. Ce que vous recevrez dépendra de l'évolution du marché et de la durée pendant laquelle vous conserverez le Fonds.

Les chiffres indiqués comprennent tous les coûts du Fonds lui-même mais pas nécessairement tous les frais dus à votre distributeur ou liés à l'enveloppe d'investissement (comptes titres ou assurance vie). Ces chiffres ne tiennent pas compte de votre situation fiscale personnelle, qui peut également influencer sur les montants que vous recevrez.

QUE SE PASSE-T-IL SI TAILOR ASSET MANAGEMENT N'EST PAS EN MESURE D'EFFECTUER LES VERSEMENTS ?

La Société de Gestion est une société de gestion de portefeuille agréée et suivie par l'Autorité des Marchés Financiers et doit respecter des règles d'organisation et de fonctionnement, notamment en matière de fonds propres, destinées à limiter tout risque de défaillance.

Il est néanmoins précisé que le patrimoine du Fonds est distinct de celui de la Société de Gestion et que, ce faisant, toute défaillance de la Société de Gestion n'entraîne pas de défaillance corrélative du Fonds, la gestion du Fonds pouvant en effet être transférée à une autre société de gestion.

Le risque de défaut du Fonds demeure donc lié au risque de défaut des obligations qu'il détient dans le cadre de la mise en œuvre de sa stratégie d'investissement. Les pertes potentielles de tout investisseur en lien avec ce risque de défaut ne sont pas couvertes par un régime de garantie ou de compensation de l'investisseur.

Il est également précisé que, l'établissement de crédit CACEIS BANK, en sa qualité de dépositaire du Fonds responsable de la bonne garde des actifs (le « **Dépositaire** ») peut présenter un risque de défaut, auquel cas les actifs ainsi conservés par le Dépositaire pourraient être perdus. Ce risque de perte des actifs est néanmoins limité du fait de l'application des règles prévues par la réglementation applicable, notamment en matière de ségrégation des actifs. Le Dépositaire est responsable en cas de manquement par négligence ou intentionnel à ses obligations en vertu de la directive OPCVM. En ce qui concerne le Fonds, le Dépositaire ne s'est pas libéré contractuellement de sa responsabilité pour la perte d'instruments financiers par le transfert contractuel de sa responsabilité à un sous-dépositaire ou à un autre délégué.

QUE VA ME COUTER CET INVESTISSEMENT ?

La réduction du rendement (RIY) montre l'incidence des coûts totaux que vous payez sur le rendement que vous pourriez obtenir de votre investissement. Les coûts totaux incluent les coûts ponctuels, les coûts récurrents et les coûts accessoires.

Il se peut que la personne qui vous vend ce Fond ou qui vous fournit des conseils à son sujet vous demande de payer des coûts supplémentaires. Si c'est le cas, cette personne vous informera au sujet de ces coûts et vous montrera l'incidence de ces coûts sur votre investissement.

Coûts au fil du temps

Le tableau ci-dessous présente les montants prélevés sur votre investissement afin de couvrir les différents types de coûts. Ces montants dépendent du montant que vous investissez, du temps pendant lequel vous détenez le produit. Les montants indiqués ici sont des illustrations basées sur un exemple de montant d'investissement et différentes périodes d'investissement possibles.

Investissement : 10,000€	Si vous sortez après 1 an	Si vous sortez après 5 ans
Coût total	539€	2,763€
Réduction du rendement par an	5.46%	3.83%

Composition des coûts

Le tableau ci-dessous indique :

- L'incidence annuelle des différents types de coûts sur le rendement que vous pourriez obtenir de votre investissement à la fin de la période d'investissement recommandée ;
- La signification des différentes catégories de coûts.

Ce tableau montre l'incidence sur le rendement par an			
Coûts ponctuels à l'entrée ou à la sortie	Coûts d'entrée	2.50% du montant que vous payez au moment de l'entrée dans l'investissement. Cela inclut les coûts de distribution de votre produit. Ce pourcentage est le maximum pouvant être prélevé, il peut donc être plus faible.	250 EUR
	Coûts de sortie	TAILOR AM ne facture pas de coût de sortie pour ce produit.	0 EUR
Coûts récurrents	Frais de gestion et autres frais administratifs d'exploitation	2,95% de la valeur de votre investissement par an. Ce pourcentage se base sur les coûts réels de l'exercice précédent.	288 EUR
	Coûts de transaction	0.01% de la valeur de votre investissement par an. Il s'agit d'une estimation des coûts encourus lorsque nous achetons et vendons les investissements sous-jacents au produit. Le montant réel varie en fonction de la quantité que nous achetons et vendons.	1 EUR
Coûts récurrents prélevés sous certaines conditions	Commissions liées aux résultats	0.00% de la valeur de votre investissement par an. Le montant réel varie en fonction de la performance de votre investissement. L'estimation ci-dessus des coûts totaux comprend la moyenne au cours des 5 derniers exercices.	0 EUR

COMBIEN DE TEMPS DOIS-JE LE CONSERVER ET PUIS-JE RETIRER DE L'ARGENT DE FAÇON ANTICIPÉE ?

Période minimale de détention requise : 5 années

Le Fonds s'adresse à des souscripteurs qui acceptent des risques liés à la détention d'actions cotées, avec une stratégie dynamique. Compte tenu de la stratégie d'investissement mise en œuvre, la durée minimum de placement est équivalente 5 années. Vous pouvez retirer votre argent chaque jour.

COMMENT PUIS-JE FORMULER UNE RECLAMATION ?

Vous pouvez adresser votre réclamation auprès de votre conseiller habituel. Vous pouvez également adresser votre réclamation à la Société de Gestion par email à l'adresse suivante : contact@tailor-am.com ou par courrier à l'adresse postale suivante : TAILOR ASSET MANAGEMENT, 23 rue Royale, 75008 PARIS. L'ensemble de la procédure de réclamation se trouve sur notre site internet www.tailor-am.com.

AUTRES INFORMATIONS PERTINENTES ?

Les informations relatives aux performances passées de ce Fonds sont disponibles dans le document intitulé « Performances passées – OPC Tailor Asset Management » accessible sur le site internet www.tailor-am.com, rubrique « Informations réglementaires ». Les données relatives aux performances passées seront présentées sur les dix dernières années.

Selon votre régime fiscal, les plus-values et revenus éventuels liés à la détention de parts de FCP peuvent être soumis à taxation. Nous vous conseillons de vous renseigner à ce sujet auprès du commercialisateur du Fonds.

Le présent OPCVM n'est pas ouvert aux résidents des Etats-Unis d'Amérique dits « US Person » (la définition est disponible sur notre site internet www.tailor-am.com).

Les détails de la politique de rémunération de Tailor Asset Management sont disponibles sur le site internet www.tailor-am.com. Un exemplaire papier de la politique de rémunération sera mis à disposition des investisseurs gratuitement et sur demande, dans un délai de 8 jours ouvrés.

Le fonds se qualifie comme un produit financier répondant à l'article 8 du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (ci-après « SFDR »). La prise en compte des risques de durabilité dans le processus d'investissement est précisée dans le code de transparence disponible sur le site internet <https://www.tailor-am.com/esg>.

Enfin, au sens de la Position-Recommandation AMF 2020-03, l'approche extra-financière mise en œuvre dans le fonds est fondée sur un engagement significatif dans la stratégie d'investissement permettant ainsi une communication centrale sur la prise en compte de critères extra-financiers.

La responsabilité de Tailor Asset Management 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'OPCVM.