ALLEGRO TRANSATLANTIC

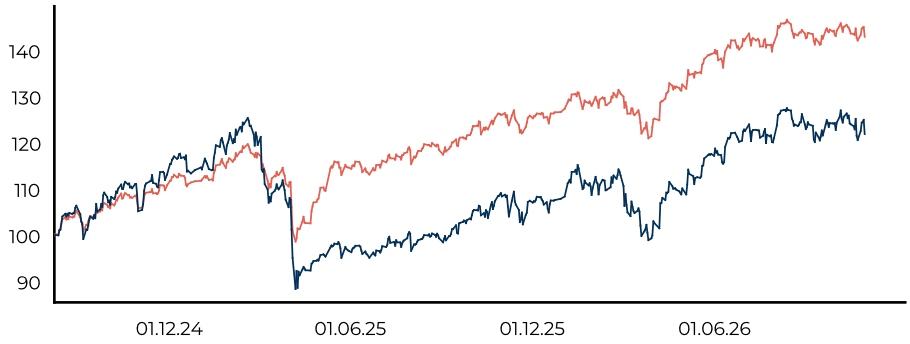
OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement du Fonds est de surperformer l'indice SOLACTIVE GBS CW DM US & Eurozone EUR NTR (SCWUEZEN) (l'« indice de référence ») sur un horizon à long terme en exploitant les opportunités d'investissement sur les marchés boursiers, tout en fournissant un flux fixe de distributions. L'indice de référence est un large indice d'actions liquides (environ 800 actions) basé sur une pondération personnalisée (50% US et 50% Eurozone).

Le Fonds est géré activement, l'exposition aux actions peut s'écarter considérablement des composantes de l'indice de référence. Le fonds est l'article 6 de la SFDR. L'exposition du Portefeuille à chacun des deux indices suivants (Euro Stoxx 50 Price EUR Index (SX5E) ; et l'Indice S&P 500 (Indice SPX) sera principalement pondérée conformément à (la « Méthodologie ») développée par la Société de Gestion. La Société de Gestion conserve le pouvoir discrétionnaire de s'écarter de cette Méthodologie à titre exceptionnel. Le portefeuille se compose principalement de positions financières à terme sur indices financiers. Les contrats à terme financiers roulés composant le Portefeuille seront sélectionnés selon une méthodologie propriétaire conçue par la Société de Gestion qui s'appuie sur une analyse financière qui classe les instruments de l'Univers d'Investissement. Le mécanisme d'exposition variable mis en place par le Fonds vise à fournir au Fonds une exposition moyenne aux marchés actions sur cinq ans supérieure à 80%. Le portefeuille sera rééquilibré mensuellement en respectant la méthodologie. Toutefois, la Société de Gestion peut décider de rééquilibrer le Portefeuille à tout moment et à sa discrétion (la « Date de Rééquilibrage »). Afin d'atténuer les risques ou d'améliorer la performance du Compartiment, l'exposition du Fonds aux marchés actions par l'intermédiaire du Portefeuille peut varier entre 0% et 200% au moins une fois par semaine. Par conséquent, l'exposition peut dériver entre ces ajustements.

Le Fonds class activée distribue un dividende fixe de 5 euros par part de fonds et par an, divisé en 12 mensualités identiques.

PERFORMANCE DEPUIS LE LANCEMENT



Performances	MTD	YTD	3 mois	6 mois	12 Derniers Mois	3 ans	Depuis le lancement
ALLEGRO TRANSATLANTIC I	-1,90%	12,96%	0,72%	10,67%	12,42%	-	22,02%
Solactive GBS CM US & Eurozone EUR Index TR	-0,35%	12,83%	0,89%	7,77%	13,35%	-	43,06%

LES PERFORMANCES PASSÉES NE REFLÈTENT PAS LES PERFORMANCES FUTURES.
La performance d'ALLEGRO TRANSATLANTIC I ci-dessus correspond à la NAV de la Class I à laquelle est rajoutée le dividende, afin d'être cohérente avec les indices Solactive, ces derniers étant exprimés 'dividendes réinvestis'.
Solactive GBS CM US & Eurozone EUR

5 MEILLEURES PERFORMANCES	Allocation	Perf. MTD*	Perf. YTD*	Contr. MTD	Contr. YTD
SGI Futures Series - US Large Cap Equity Index	40,00%	-1,83%	7,14%	-0,07%	6,84%
SGI Futures Series - European Large Cap Equity	60,00%	-2,45%	6,61%	-2,08%	3,74%

Les performances sont calculées en devise du portefeuille

5 MOINS BONNES PERFORMANCES	Allocation	Perf. MTD*	Perf. YTD*	Contr. MTD	Contr. YTD
SGI Futures Series - European Large Cap Equity	60,00%	-2,45%	6,61%	-2,08%	3,74%
SGI Futures Series - US Large Cap Equity Index	40,00%	-1,83%	7,14%	-0,07%	6,84%

Les performances sont calculées en devise du portefeuille

SOCIETE GENERALE
Investment Solutions

30 Octobre 2026

CARACTÉRISTIQUES

Structure Juridique
SICAV

Classe
I

Devise de Référence
EUR

Date de Lancement de la Classe
08 Août 2024

Dividende
Distribuant

Société de Gestion
SG IS (FRANCE)
(Groupe SOCIETE GENERALE)

Dépositaire
SOCIETE GENERALE LUXEMBOURG

Code ISIN
LU2667747617

Souscription minimale initiale
EUR 1000

Souscription minimale ultérieure
-

Frais d'entrée/sortie
Jusqu'à 5% / Jusqu'à 1%

Frais de gestion et administratifs
0,75%

Frais de Performance
-

Liquidité
Quotidienne

POINTS CLÉS

Actif Net du Fonds (M EUR)
21,38 Mio. EUR

Performance annualisée*
9,35%

Levier
1,79

Toutes les performances sont calculées sur la base de valeurs liquidatives officielles, déduction nette des frais.

*Depuis le lancement

INDICATEURS DE RISQUE

	Depuis le lancement
	Classe*
Volatilité	20,57%
Ratio de Sharpe	0,35
Perte Maximale	-29,47%
Beta	1,31

*Depuis le lancement

ALLEGRO TRANSATLANTIC

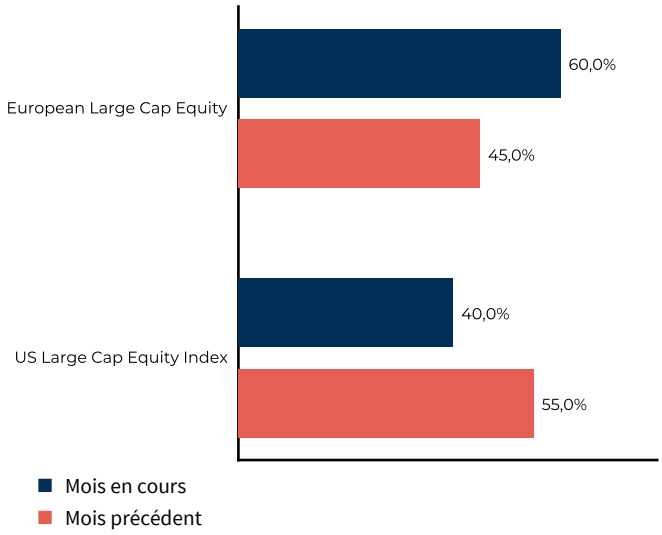
30 Octobre 2026

PERFORMANCES MENSUELLES DU FONDS

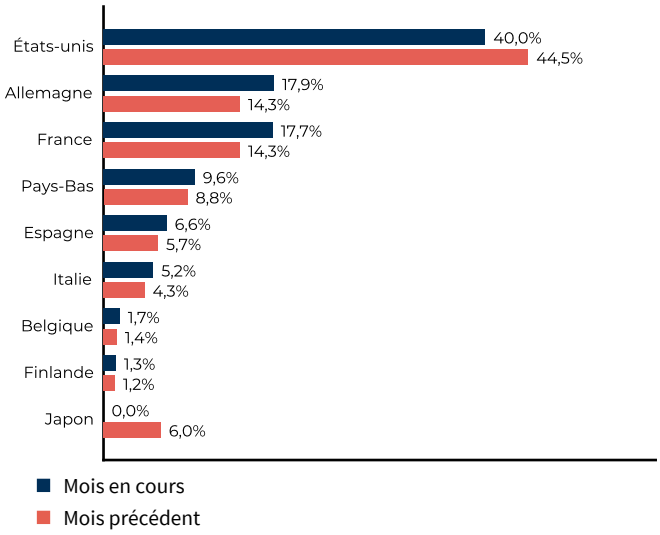
	Jan	Fév	Mars	Avril	Mai	Juin	Juil	Août	Sep	Oct	Nov	Déc	YTD
2024								6,52%	1,79%	-2,86%	7,53%	0,86%	14,23%
2025	7,02%	-2,11%	-11,25%	-10,88%	2,28%	-0,10%	3,90%	-0,99%	4,11%	4,79%	-0,87%	0,40%	-5,43%
2026	2,08%	2,59%	-11,53%	10,17%	6,77%	4,10%	-1,14%	2,45%	0,22%	-1,90%			12,96%

Les performances passées ne reflètent pas les performances futures.
*Depuis le lancement

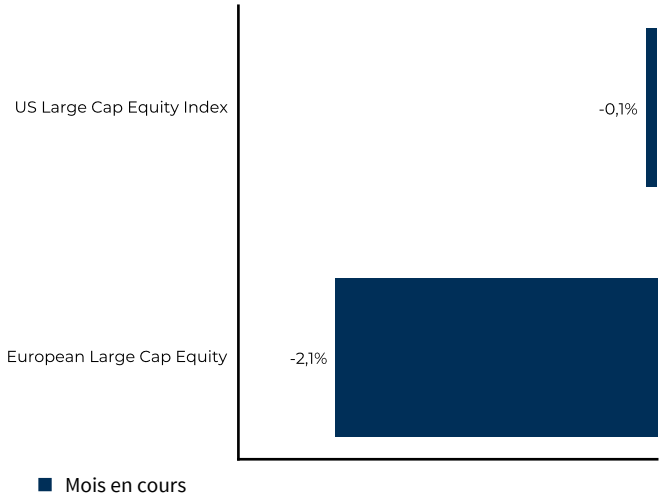
ALLOCATION SECTORIELLE



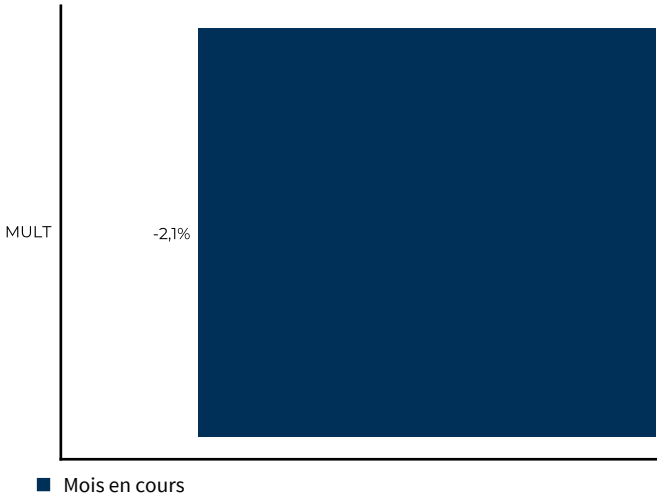
ALLOCATION GÉOGRAPHIQUE



CONTRIBUTION MENSUELLE PAR SECTEUR



CONTR. MENS. PAR ZONE GÉOGRAPHIQUE



COMMENTAIRE MENSUEL

Octobre 2026 a mis en évidence une nette divergence transatlantique. Les marchés américains ont été pénalisés par une correction historique du secteur de l'IA et des semi-conducteurs, une inflation plus élevée qu'attendu, la flambée des prix du pétrole et un positionnement extrêmement baissier des investisseurs, le Nasdaq-100 étant le plus durement touché.
À l'inverse, l'Europe a bénéficié de sa sous-exposition structurelle au thème de l'IA ainsi que d'une rotation des investisseurs vers les secteurs défensifs et industriels. Le Stoxx 600 a enregistré sa meilleure performance depuis juin, tandis que la France a souffert d'un désintérêt marqué des investisseurs en raison des incertitudes politiques et budgétaires, et que l'Euro Stoxx 50 a terminé le mois en baisse sous l'effet de son exposition plus importante aux financières et aux valeurs technologiques.
Les banques centrales ont conservé un ton globalement restrictif : la Réserve fédérale américaine (Fed) et la Banque centrale européenne (BCE) avaient toutes deux relevé leurs taux en septembre et laissaient entendre que d'autres hausses restaient possibles. De son côté, la Banque d'Angleterre (BoE), bien qu'ayant maintenu ses taux inchangés, s'est rapprochée d'un premier relèvement depuis plus de trois ans.
La forte croissance du PIB américain au troisième trimestre (+3,4%) a apporté un certain soutien au scénario macroéconomique. Néanmoins, la persistance des pressions inflationnistes et le niveau élevé des coûts de l'énergie ont entretenu l'incertitude concernant l'évolution future des taux d'intérêt à l'approche du mois de novembre.

DISCLAIMER

Le présent document, de nature publicitaire, n'a pas de valeur contractuelle. Son contenu n'est pas destiné à fournir un service d'investissement, il ne constitue ni une offre de produit ou service, ni une recommandation personnalisée sur un produit financier, ni une sollicitation d'aucune sorte, ni un conseil juridique, comptable ou fiscal de la part de Société Générale Investment Solutions (France). La référence à certains instruments financiers, le cas échéant, est donnée à titre d'illustration pour mettre en avant certaines valeurs présentes ou qui ont été présentes dans le portefeuille du fonds. Elle ne constitue pas une recommandation d'investissement dans ces instruments. Les informations sur les performances passées éventuellement reproduites dans le présent document ne garantissent en aucun cas les performances futures. Ce document est élaboré à partir de sources que Société Générale Investment Solutions (France) considère comme étant fiables et exactes au moment de sa réalisation mais qui n'ont pas été certifiées de manière indépendante. Toutes les informations contenues dans ce document peuvent être modifiées sans préavis. Ce document ne contient pas toutes les informations nécessaires et suffisantes à la prise de décision d'investissement. Avant toute décision finale d'investissement dans le produit financier visé dans ce document, l'investisseur doit prendre connaissance de l'ensemble des informations contenues dans la documentation réglementaire du fonds, et notamment, si applicable, du Document d'Informations Clés (DIC) en vigueur, disponible sur simple demande auprès de votre conseiller, sur le site de Société Générale Investment Solutions (France) https://www.investmentsolutions.societegenerale.fr ainsi que le prospectus en vigueur également disponible sur simple demande auprès de Société Générale Investment Solutions (France) ou de votre conseiller. Nous vous invitons plus particulièrement à prendre connaissance des coûts et charges du fonds, qui ont une incidence négative sur sa performance, ainsi que des facteurs de risques spécifiques à ce fonds. L'investisseur potentiel doit également s'assurer de la compatibilité du produit avec sa situation financière, ses objectifs d'investissement, ses connaissances et son expérience en matière d'instruments financiers, son degré d'acceptation du risque et sa capacité à en subir les pertes ainsi que ses préférences en matière de durabilité des produits financiers. En conséquence, Société Générale Investment Solutions (France) ne peut en aucun cas être tenue responsable, directement ou indirectement, de toutes les conséquences, notamment financières, résultant d'opérations sur instruments financiers conclues sur la base de ce seul document qui ne se substitue pas aux documents réglementaires et aux documents d'informations périodiques du fonds. L'accès au fonds peut faire l'objet de restriction à l'égard de certaines personnes ou de certains pays. Il ne peut notamment être offert ou vendu, directement ou indirectement, au bénéfice ou pour le compte d'une « U.S. person » selon la définition de la réglementation américaine « Regulation S» et/ou FATCA. Le présent document est émis par Société Générale Investment Solutions (France), société de gestion de portefeuille agréée par l'Autorité des marchés financiers sous le numéro GP 06000029, S.A.S au capital de 2.000.000 €, ayant son siège au 29 Boulevard Haussmann, 75009 Paris immatriculée au Registre du Commerce et des Sociétés de Paris sous le numéro 450 777 008 et immatriculée à l'ORIAS en tant qu'intermédiaire en assurances sous le numéro 24007754. De plus amples détails sont disponibles sur le site de Société Générale Investment Solutions (France) : https://www.investmentsolutions.societegenerale.fr.
N°ADEME: FR231725_01YSGB