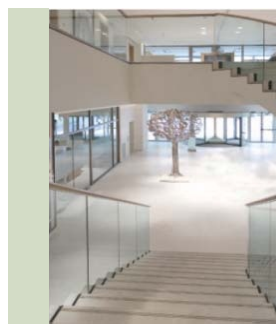


# ABN AMRO Sustainable Dynamic Profile Part F



## INFORMATIONS CLÉS

Valeur liquidative	109,55 €
Performance depuis la création	13,8 %
Performance depuis le début de l'année	10,9 %
Actif net du portefeuille	16,9 M€
Code ISIN	FR0013062866
Fonds ISR	Oui

## CARACTÉRISTIQUES PRINCIPALES

### Objectif de gestion

Le fonds a pour objectif d'offrir une performance supérieure à celle de son indice de référence composite par une allocation dynamique en supports actions, obligations et monétaire. L'allocation de référence de ABN AMRO Sustainable Dynamic Profile est de 60 à 100% en risques actions. L'ensemble des investissements concernent la zone euro.

Le fonds intègre depuis le 7 avril 2014 dans son processus de gestion en plus des critères financiers, des critères ESG liés à l'investissement Socialement Responsable (ISR).

### Politique d'investissement

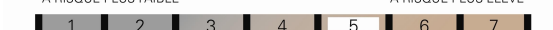
L'allocation d'actifs est le point de départ du processus d'investissement, elle se base sur une analyse de l'environnement économique et boursier mondial. Le gérant détermine l'exposition nette du portefeuille aux marchés actions et obligataires.

La sélection des valeurs au sein de la poche action est issue de la combinaison d'une approche Top-Down (approche macro-économique et sectorielle) et Bottom-Up (choix de valeur).

- Fonds géré par : ABN AMRO Investment Solutions
- Date de création de la part : 04/01/2016
- Affectation des revenus : Capitalisation / Distribution
- Nature juridique : FCP de droit français
- Durée de placement recommandée : Supérieure à 5 ans
- Indicateur de référence : 75% Euro Stoxx (dividendes réinvestis)+ 15% FTSE MTS 3-5 ans + 10% Eonia
- Devise : EUR
- Valorisation : Quotidienne
- Souscriptions / rachats : Avant 11h30
- Souscription minimale initiale : 1 part
- Pays de commercialisation : France
- Frais de gestion fixes max : 0,90% TTC
- Commissions de surperformance : Néant
- Droits d'entrée max : Non acquis : 5% - Acquis : 0%
- Droits de sortie max : Non acquis : 0% - Acquis : 0%
- Dépositaire : CACEIS Bank
- Valorisateur : CACEIS Fund Administration

### Échelle de risque :

À RISQUE PLUS FAIBLE À RISQUE PLUS ÉLEVÉ

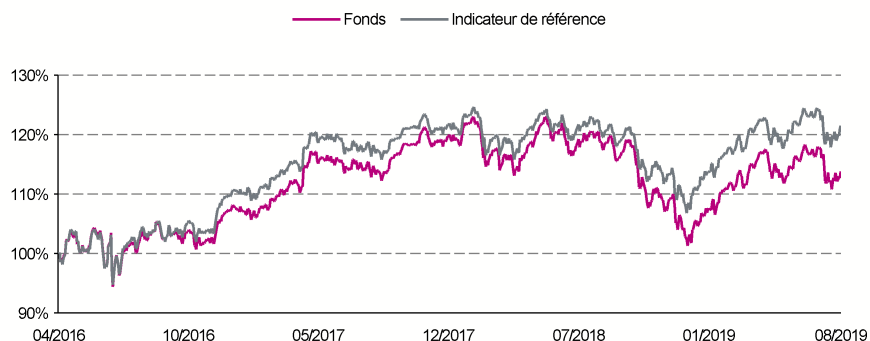


Remendement potentiellement plus faible Remendement potentiellement plus élevé

## COMMENTAIRE DE GESTION

Les investisseurs se sont repositionnés vers les actifs et les titres défensifs en août pour se protéger de la guerre commerciale entre les États-Unis et la Chine et du ralentissement de la croissance mondiale. Les surprises économiques ont globalement été négatives et les perspectives bénéficiaires des sociétés revues à la baisse. La guerre commerciale a contribué à de nouveaux pics de volatilité et fait de ce mois d'août le plus turbulent depuis 4 ans, selon l'indice de volatilité Vix. Finalement, la dernière semaine s'est accompagnée d'un regain d'appétit pour le risque avec l'anticipation d'un apaisement des tensions commerciales. Au total, les marchés actions ont enregistré une légère baisse en août (-1,8% pour le S&P 500 et -1,2% pour l'Euro Stoxx), effaçant les gains enregistrés depuis mi-juin seulement. Les rendements des emprunts publics ont continué de baisser dans la zone euro et en particulier en Italie avec l'espoir d'un nouveau gouvernement de coalition. Le taux à 10 ans allemand a ainsi atteint -0,707% en fin de mois, après avoir battu des niveaux records.

## ÉVOLUTION DES PERFORMANCES\*



## PERFORMANCES\*

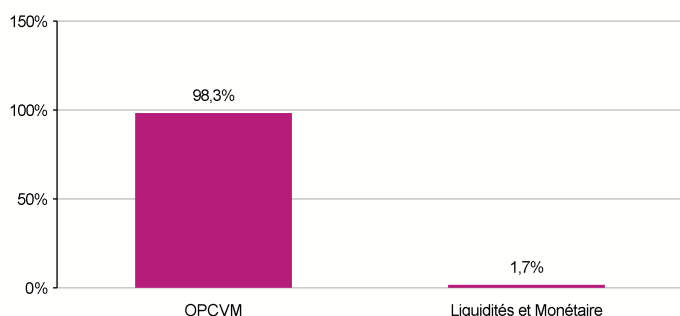
	Fonds	Indicateur de référence	Ecart de performance
Août 2019	-1,93 %	-0,86 %	-1,07 %
Depuis le début de l'année	10,90 %	11,97 %	-1,07 %
1 an	-3,91 %	0,97 %	-4,88 %
3 ans	9,65 %	17,10 %	-7,45 %
5 ans	-	-	-
Depuis la création	13,81 %	21,53 %	-7,72 %
2018	-13,24 %	-9,63 %	-3,61 %
2017	10,17 %	9,33 %	0,84 %
2016	-	-	-
2015	-	-	-
2014	-	-	-

## RATIOS DE RISQUE ET DE PERFORMANCE

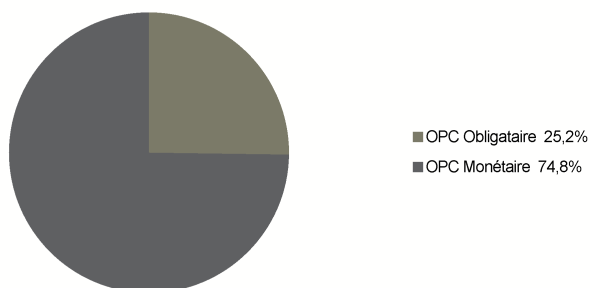
	Fonds		Indicateur de référence	
	1 an	3 ans	1 an	3 ans
Volatilité	13,00 %	9,57 %	10,84 %	8,67 %
Tracking error	8,05 %	4,03 %	-	-
Beta actions	0,94	1,00	-	-
Ratio d'information	-0,61	-0,57	-	-
Ratio de Sharpe	-0,27	0,36	0,12	0,67

\* Les performances passées ne préjugent pas des performances futures. Les performances sont nettes de frais hors frais de souscription. NOBC Dynamique a été absorbé dans Neufilze Dynamique ISR (C) le 07/04/2014.

▶ RÉPARTITION PAR TYPE D'ACTIFS



▶ RÉPARTITION DE LA POCHÉ TAUX



▶ APPROCHE ISR

L'ensemble des actifs du fonds respectent les critères d'investissement socialement responsable.

Cette approche consiste à sélectionner les entreprises ayant les meilleures pratiques environnementales, sociales et de gouvernance.

▶ 5 MEILLEURES CONTRIBUTIONS MENSUELLES

Libellés	Poids*	Contribution
ROBECO EURO GOV BONDS-FH CAP	4,61 %	0,14 %
AGIF-ALZ SEC-W	11,26 %	0,00 %
MIR EURO S EQ IA	14,89 %	-0,23 %
ABN A EUR SUST EQ NC	19,06 %	-0,32 %
LAZARD EQUITY SRI C	16,62 %	-0,45 %

\* Poids = pondération moyenne sur la période

▶ 5 MOINS BONNES CONTRIBUTIONS MENSUELLES

Libellés	Poids*	Contribution
METROPOLE Euro SRI W	14,19 %	-0,60 %
SYCOM.SELEC.RESP.I	16,22 %	-0,45 %
LAZARD EQUITY SRI C	16,62 %	-0,45 %
ABN A EUR SUST EQ NC	19,06 %	-0,32 %
MIR EURO S EQ IA	14,89 %	-0,23 %

\* Poids = pondération moyenne sur la période

▶ PRINCIPAUX MOUVEMENTS

Achat	Vente
-	-
-	-
Renforcement	Allègement
-	-
-	-

▶ 10 PRINCIPALES LIGNES

Libellés	Poids
ABN AMRO EURO SUSTAINABLE EQUITIES	19,1 %
LAZARD EQUITY SRI C	16,7 %
SYCOMORE SEL RESPONSABLE I	16,1 %
MIROVA EURO SUST EQY FD I/A EUR	14,7 %
METROPOLE Euro SRI W	14,1 %
ALLIANZ SECURICASH SRI-W	13,2 %
ROBECO EURO GOV BONDS-FH CAP	4,5 %

Poids des 10 principales lignes : 98,4 %

Ce document d'information ne constitue en aucun cas une offre ou recommandation d'achat ou de vente d'instruments financiers. Il vous appartient (1) de vérifier que la réglementation qui vous est applicable n'interdit pas l'achat/la vente et/ou la commercialisation du produit et (2) de vous assurer de l'adéquation de l'investissement en fonction des objectifs et des considérations légales et fiscales qui vous sont propres. Cet OPC ne bénéficie d'aucune garantie. Les fluctuations de taux de change peuvent influencer à la hausse ou à la baisse sur la valeur de votre placement. Pour une description détaillée des risques du produit, nous vous recommandons de vous référer à la section « profil de risque » du prospectus. Toute souscription dans cet OPC doit se faire après avoir pris connaissance du prospectus en vigueur, disponible sur simple demande auprès d'ABN AMRO Investment Solutions ou sur [www.abnamroinvestmentsolutions.fr](http://www.abnamroinvestmentsolutions.fr). ABN AMRO Investment Solutions, société de gestion de portefeuilles, agréé par l'Autorité des Marchés Financiers (AMF) sous le numéro n° GP 99-27.

Etoiles communiquées par Morningstar Inc, tous droits réservés. Notation Overall.