

DARWIN DIVERSIFIE 60-80 - C

REPORTING

Communication
Publicitaire

31/08/2024

DIVERSIFIÉ ■

Données clés (Source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : **142,63 (EUR)**
Date de VL et d'actif géré : **30/08/2024**
Actif géré : **90,55 (millions EUR)**
Code ISIN : **FR0010551424**
Indice de référence :
35% EURO STOXX 50 + 35% CAC 40 + 30% ESTR CAPITALISE (OIS)

Objectif d'investissement

Le fonds est investi en actions et produits de taux de la zone Euro. L'exposition aux marchés actions, comprise entre 60 et 80%, évolue en fonction des mouvements sur les marchés dans l'optique de tirer parti des hausses et de minimiser l'impact des baisses. Cette diversification sur les marchés actions et taux de la zone Euro est réalisée au travers d'OPC actions, obligations et monétaires internes ou externes au Groupe.

Indicateur de risque (Source : Fund Admin)



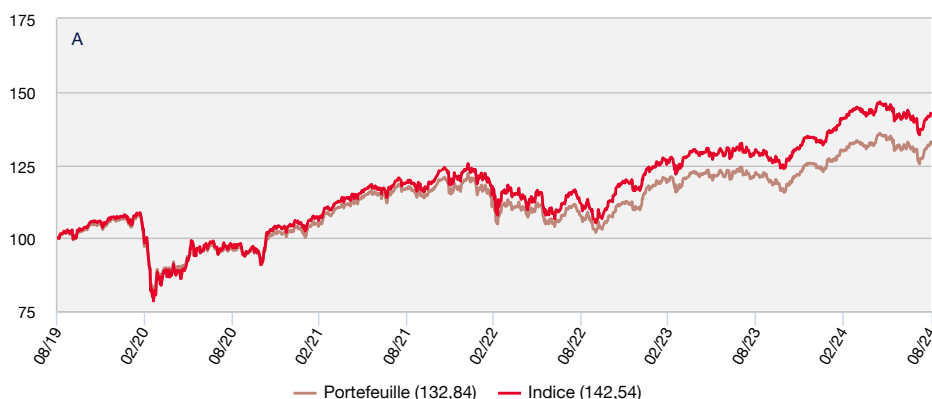
Risque le plus faible

Risque le plus élevé

L'indicateur de risque part de l'hypothèse que vous gardez le produit pendant > à 5 ans. L'indicateur synthétique de risque permet d'apprécier le niveau de risque de ce produit par rapport à d'autres. 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.

Performances (Source : Fund Admin) - Les performances passées ne préjugent pas des performances futures

Evolution de la performance (base 100) * (Source : Fund Admin)



A : Depuis le 01/01/2012, l'indicateur de comparaison est calculé dividendes réinvestis.

Performances glissantes * (Source : Fund Admin)

| Depuis le | Depuis le | 1 mois | 3 mois | 1 an | 3 ans | 5 ans | 10 ans | Depuis le |
|---------------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| | 29/12/2023 | 31/07/2024 | 31/05/2024 | 31/08/2023 | 31/08/2021 | 30/08/2019 | 29/08/2014 | 28/12/2007 |
| Portefeuille | 5,97% | 1,89% | -0,89% | 8,90% | 13,79% | 32,84% | 52,43% | 42,63% |
| Indice | 6,18% | 1,18% | -1,31% | 9,96% | 19,88% | 42,54% | 74,18% | 58,02% |
| Ecart | -0,21% | 0,70% | 0,42% | -1,06% | -6,09% | -9,70% | -21,75% | -15,39% |

Performances calendaires * (Source : Fund Admin)

| | 2023 | 2022 | 2021 | 2020 | 2019 | 2018 | 2017 | 2016 | 2015 | 2014 |
|---------------------|--------|--------|--------|--------|--------|---------|-------|--------|--------|--------|
| Portefeuille | 14,37% | -8,39% | 17,36% | -3,54% | 17,34% | -11,94% | 7,83% | 0,75% | 10,05% | 0,47% |
| Indice | 15,48% | -5,58% | 18,37% | -2,35% | 19,41% | -7,37% | 7,18% | 4,03% | 6,40% | 2,15% |
| Ecart | -1,11% | -2,81% | -1,01% | -1,20% | -2,07% | -4,57% | 0,65% | -3,28% | 3,64% | -1,68% |

* Source : Fund Admin Les performances sont calculées dans la devise de référence, sur des données historiques. Les performances affichées sont nettes de frais de gestion. (1) Les performances calendaires couvrent des périodes complètes de 12 mois pour chaque année civile. La valeur des investissements peut varier à la hausse ou à la baisse selon l'évolution des marchés.

Indicateur(s) glissant(s) (Source : Fund Admin)

| | 1 an | 3 ans | 5 ans |
|-----------------------------------|-------|--------|--------|
| Volatilité du portefeuille | 7,96% | 10,79% | 11,00% |
| Volatilité de l'indice | 8,10% | 11,82% | 12,15% |
| Tracking Error ex-post | 1,74% | 2,02% | 2,09% |
| Ratio d'information | -0,56 | -0,89 | -0,72 |
| Ratio de sharpe | 0,57 | 0,23 | 0,44 |

* La volatilité est un indicateur statistique qui mesure l'amplitude des variations d'un actif autour de sa moyenne. Exemple : des variations de +/- 1,5% par jour sur les marchés correspondent à une volatilité de 25% par an.

Analyse des rendements (Source : Fund Admin)

| | |
|--------------------------------------|---------|
| Baisse maximale | -41,37% |
| Délai de recouvrement (jours) | 2 172 |
| Moins bon mois | 01/2008 |
| Moins bonne performance | -10,13% |
| Meilleur mois | 11/2020 |
| Meilleure performance | 10,98% |

Indicateurs (Source : Amundi)

| | Portefeuille | Indice |
|-------------------------|--------------|--------|
| Sensibilité | 0,00 | 0,00 |
| Nombre de lignes | 58 | 73 |

La sensibilité (en points) représente le changement en pourcentage du prix pour une évolution de 1% du taux de référence

Commentaire de gestion

Le scénario de ralentissement marqué de l'économie américaine qui était depuis plusieurs mois écarté par les investisseurs est revenu sur le devant de la scène. Ce changement de narratif ainsi que la hausse surprise des taux de la Banque du Japon ont entraîné une chute brutale des indices actions en début de mois.

Mais, aidé par la déclaration du président de la banque centrale américaine confirmant une réduction des taux à venir lors de prochaine réunion de septembre, les marchés actions se sont vite redressés.

Ainsi sur le mois, le CAC 40 termine en hausse de +1.32%, l'Eurostoxx 50 progresse à +1.79%, le S&P 500 en dollar de +2.43%, et le MSCI Emergent de +1.64%.

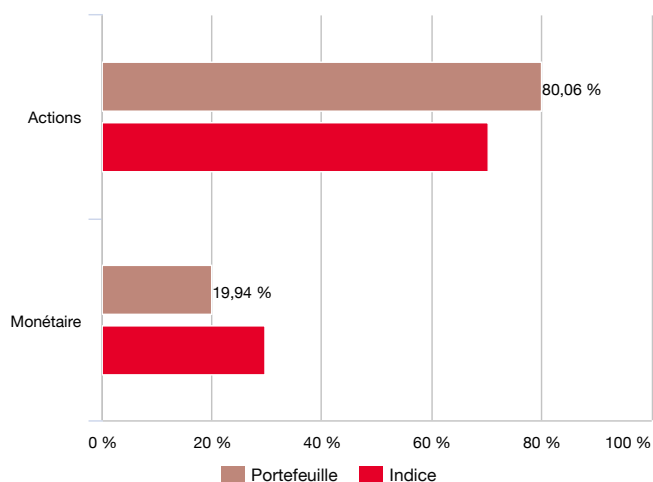
Coté taux, le rendement du 10 ans US a continué sa baisse (-13 bps) pendant que le 10ans Allemand restait stable à 2.30%.

La baisse des marchés actions en début de mois a actionné le processus d'allocation systématique du portefeuille. Nous avons par conséquent augmenté l'exposition actions globale de 10% afin de respecter ce processus.

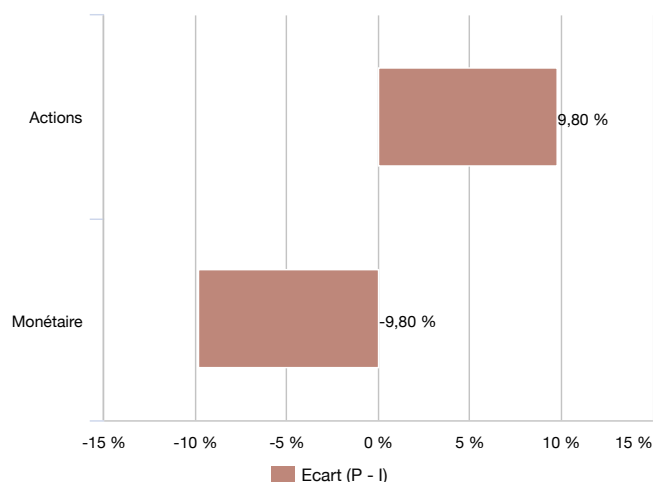
Le fonds a surperformé son indice sur le mois, aidé à la fois par sa sur exposition globale aux actions et par la baisse des taux.

Composition du portefeuille (Source : Amundi)

Allocation d'actifs (Source : Amundi)



Allocation d'actifs en relatif (Source : Amundi)



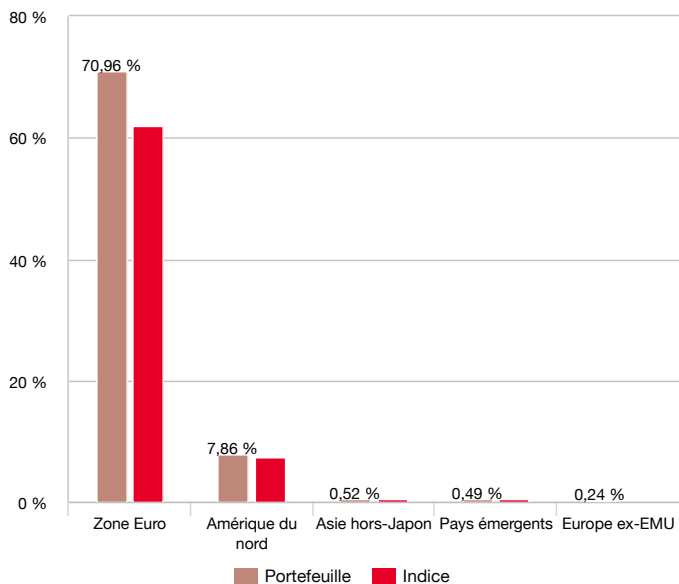
Principales lignes en portefeuille (Source : Amundi)

| | Portefeuille |
|-------------------------------------|--------------|
| A-F EUROLAND EQ-I2 EUR | 16,87% |
| AMUNDI PEA COURT TERME | 11,51% |
| AMUNDI SERENITE PEA-I(C) | 8,26% |
| SG ACT EURO SELECTION | 7,15% |
| AMUNDI ACT FRA ISR-Z (C) | 5,26% |
| SG VALOR ALPHA ACT.FRA.Z FCP | 5,19% |
| AMUNDI FRANCE ENGAGEMENT-Z (C) | 4,82% |
| Amundi IS CAC 40 ESG DR ETF-C (PAR) | 4,07% |
| SG ACT FRANCE - C | 3,96% |
| AMUNDI ACT EURO ISR-Z (C) | 2,57% |

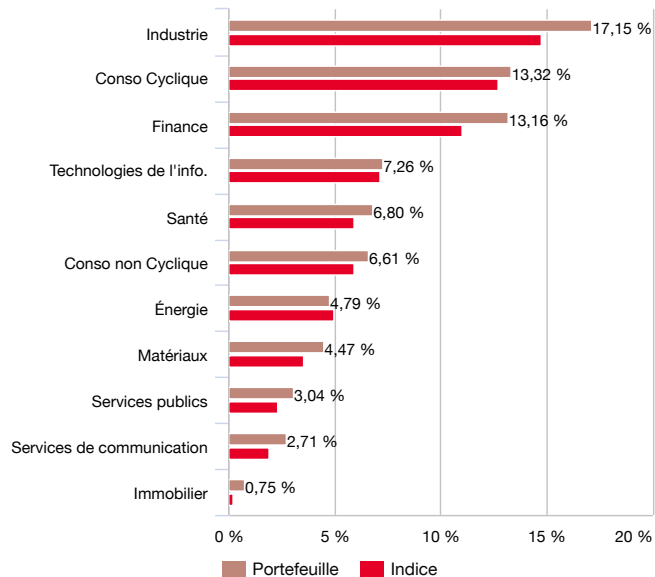
DIVERSIFIÉ ■

Composition du portefeuille - Analyse des actions (Source : Amundi)

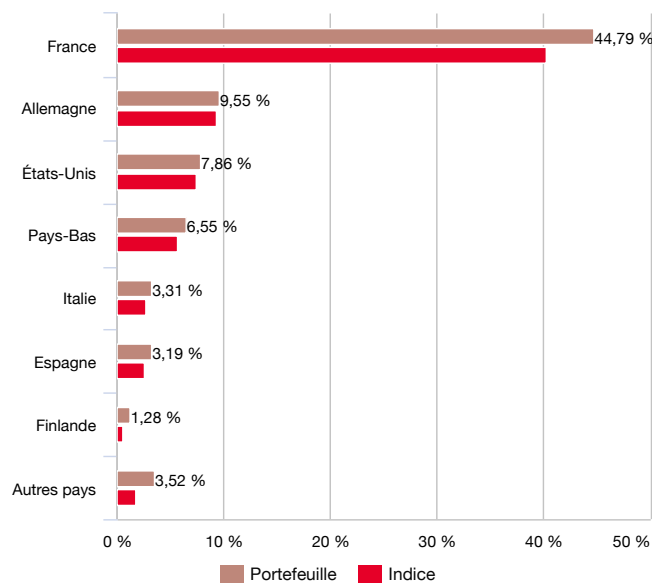
Répartition par zones géographiques (Source : Amundi)



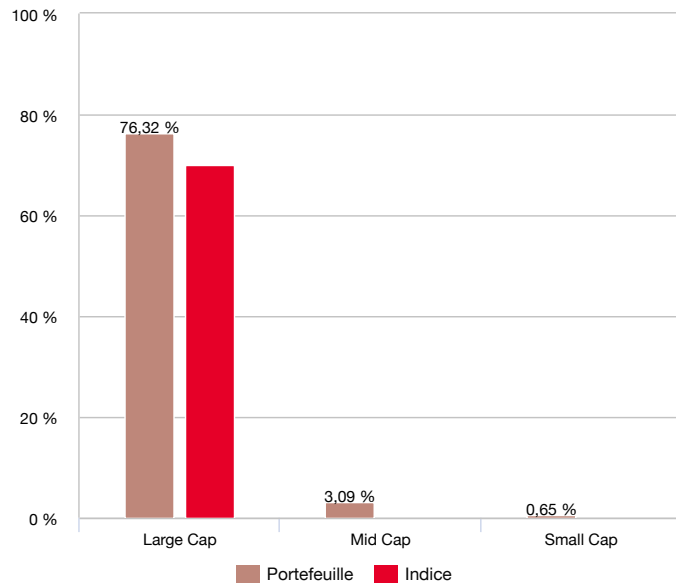
Répartition par secteurs (Source : Amundi)



Répartition par pays (Source : Amundi)



Répartition par capitalisations boursières (Source : Amundi)



Caractéristiques principales (Source : Amundi)

| | |
|---|--|
| Forme juridique | Fonds Commun de Placement (FCP) |
| Droit applicable | de droit français |
| Société de gestion | Société Générale Gestion |
| Dépositaire | SGSS - Paris |
| Date de création de la classe | 28/12/2007 |
| Devise de référence de la classe | EUR |
| Affectation des sommes distribuables | Capitalisation |
| Code ISIN | FR0010551424 |
| Souscription minimum: 1ère / suivantes | 1 millième part(s)/action(s) / 1 millième part(s)/action(s) |
| Périodicité de calcul de la VL | Quotidienne |
| Limite de réception des ordres | Ordres reçus chaque jour J avant 18:30 |
| Frais d'entrée (maximum) | 2,00% |
| Frais de gestion directs annuels maximum | 1,20% TTC |
| Frais de gestion indirects annuels maximum | 2,75% TTC |
| Commission de surperformance | Oui |
| Commission de surperformance (% par an) | 20,00 % |
| Frais de sortie (maximum) | 0,00% |
| Frais de gestion et autres coûts administratifs ou d'exploitation | 2,23% |
| Durée minimum d'investissement recommandée | > à 5 ans |
| Historique de l'indice de référence | 30/11/2021 : 35.00% EURO STOXX 50 + 35.00% CAC 40 + 30.00% ESTR CAPITALISE (OIS) 01/09/2010 : 35.00% EURO STOXX 50 + 35.00% CAC 40 + 30.00% EONIA CAPITALISE (O.I.S.) (BASE 360) - DISCONTINUED 28/12/2007 : 35.00% EURO STOXX 50 + 35.00% CAC 40 + 30.00% EONIA CAPITALISE |

Avertissement

Document simplifié et non contractuel, destiné à être remis exclusivement aux porteurs de parts. Les caractéristiques principales du fonds sont mentionnées dans sa documentation juridique, disponible sur le site de l'AMF ou sur simple demande au siège social de la société de gestion. La documentation juridique vous est remise avant toute souscription à un fonds. Investir implique des risques : les valeurs des parts ou actions des OPC sont soumises aux fluctuations du marché, les investissements réalisés peuvent donc varier tant à la baisse qu'à la hausse. Par conséquent, les souscripteurs des OPC peuvent perdre tout ou partie de leur capital initialement investi. Il appartient à toute personne intéressée par les OPC, préalablement à toute souscription, de s'assurer de la compatibilité de cette souscription avec les lois dont elle relève ainsi que des conséquences fiscales d'un tel investissement et de prendre connaissance des documents réglementaires en vigueur de chaque OPC. La source des données du présent document est Amundi sauf mention contraire. La date des données du présent document est celle indiquée en tête du document sauf mention contraire.