

Exane Pleiade Trésorerie Fund

(part P, Euro)

Long/short actions market neutral

Univers : Multi-secteurs

Code ISIN : FR0010560649 | Date de lancement : 27 décembre 2007

EuroHedge

Absolute Ucits
Awards 2017

Winner



Gérant : Eric Lauri

Description du fonds

Exane Pleiade Trésorerie vise à réaliser une performance absolue, régulière et peu corrélée avec les classes d'actifs traditionnelles.

Chiffres clés

- Performance mensuelle : **0.03%**
- 2019 : **0.18%**
- VL (€) : **112,99**
- Actif net du fonds (Mio €) : **59**
- Encours de la stratégie (Mio €) : **756**

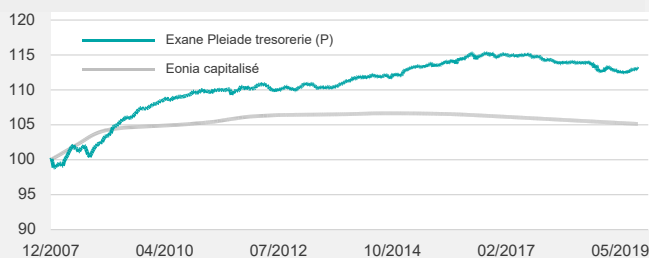
Composition du portefeuille

	LONG	SHORT
Nombre de lignes	118	126
Contribution (bps)	68	-64

Top 5 (poids)	Top 5 (poids)
Roche	Novartis
Sanofi	Merck
AstraZeneca	Aena
E.On	Snam
Korian	Industrie

Performances

	12 mois	2 ans	3 ans	5 ans	Depuis création
Cumulées					
Exane Pleiade trésorerie (P)	-0.83%	-1.54%	-1.90%	0.97%	12.99%
Eonia capitalisé (*)	-0.37%	-0.73%	-1.09%	-1.43%	5.13%
Annualisées					
Exane Pleiade trésorerie (P)	-0.83%	-0.77%	-0.64%	0.19%	1.04%
Eonia capitalisé (*)	-0.37%	-0.37%	-0.36%	-0.29%	0.43%



*Le fonds cherche à restituer une performance absolue, régulière et décorrélée des marchés. L'eonia capitalisé n'est pas l'indicateur de référence du fonds.

Risques

	2 ans	Depuis création
Volatilité	0.8%	1.0%
Volatilité 12 mois min./max.	0.5% / 1.0%	0.5% / 1.8%
Ratio de sharpe	-0,5	0,7

Contributions*/ expositions

	Exposition brute moyenne	Contribution nette
Alimentation, Boissons	1.17%	0.01%
Assurance	1.87%	0.01%
Automobile	1.01%	-0.02%
Banques	3.37%	0.01%
Chimie	4.39%	0.02%
Construction	1.93%	0.01%
Distribution	1.27%	-0.02%
Immobilier	1.09%	-0.01%
Industrie	6.94%	-0.03%
Loisirs	0.25%	0.01%
Média	3.03%	-0.09%
Produits domestiques & soins	0.88%	0.00%
Pétrole et gaz	1.93%	-0.00%
Ressources de base	0.08%	-0.00%
Santé	9.79%	0.15%
Services aux collectivités	4.46%	-0.02%
Services financiers	0.58%	-0.01%
Technologie	1.87%	0.03%
télécommunications	4.17%	0.01%
Total	50.1%	0.04%

Meilleures contributions	Contribution	Poids moyen
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	0.06%	1.09%
NOVARTIS AG-REG	0.03%	-0.85%
COVESTRO AG	0.03%	0.45%
ASML HOLDING NV	0.02%	0.28%
SANOFI	0.07%	0.95%

Pires contributions	Contribution	Poids moyen
EDF	-0.04%	0.41%
MERCK KGAA	-0.04%	-0.77%
FRESENIUS SE & CO KGAA	-0.03%	0.54%
WACKER CHEMIE AG	-0.03%	0.15%
DELIVERY HERO SE	-0.03%	0.17%

*Contribution en alpha : contribution relative du titre par rapport à son secteur dans la performance du fonds

Mouvements acheteurs
CLARIANT AG-REG
GLAXOSMITHKLINE PLC
BANCO SANTANDER SA
ALSTOM
E.ON SE

Mouvements vendeurs
SNAM SPA
ESSILORLUXOTTICA
GIVAUDAN-REG
MERCK & CO. INC.
NOVO NORDISK A/S-B

Exposition du fonds	30 septembre 2019	Moyenne sur 12 mois
Long	28.4%	27.7%
Short	-27.2%	-25.6%
Brute	55.6%	53.3%
Nette/nette ajustée du beta	1.2% / 1.7%	2.1% / 2.8%
Top 5 des positions à l'achat	4.6%	3.5%

Historique des performances

	2019	2018	2017	2016	2015	2014	2013	2012	2011	2010	2009
Janvier	+0.26%	-0.24%	+0.07%	+0.01%	+0.61%	+0.19%	+0.42%	0.00%	-0.35%	+0.25%	+0.74%
Février	+0.14%	-0.11%	-0.07%	+0.19%	+0.18%	+0.23%	-0.21%	+0.44%	+0.06%	+0.16%	+0.16%
Mars	-0.37%	-0.01%	+0.06%	+0.11%	+0.17%	+0.05%	+0.12%	+0.11%	+0.29%	+0.37%	+1.12%
Avril	-0.05%	-0.04%	-0.17%	+0.29%	+0.19%	-0.04%	-0.43%	-0.35%	-0.06%	+0.10%	+0.39%
Mai	-0.22%	+0.07%	+0.11%	+0.27%	-0.09%	+0.30%	+0.17%	-0.46%	+0.03%	-0.16%	+0.45%
Juin	+0.10%	-0.10%	+0.03%	-0.47%	0.00%	-0.25%	-0.06%	0.00%	-0.01%	+0.25%	+0.47%
Juillet	+0.12%	+0.04%	+0.03%	+0.13%	+0.40%	+0.03%	-0.12%	+0.04%	+0.05%	+0.25%	-0.04%
Août	+0.18%	+0.01%	-0.28%	+0.32%	-0.19%	+0.08%	+0.13%	+0.25%	-0.19%	0.00%	+0.43%
Septembre	+0.03%	+0.05%	+0.06%	+0.03%	-0.03%	-0.10%	+0.21%	+0.01%	+0.05%	+0.14%	+0.70%
Octobre	-	-0.19%	-0.24%	+0.03%	+0.26%	+0.29%	+0.21%	-0.24%	+0.40%	+0.35%	+0.12%
Novembre	-	-0.26%	-0.21%	-0.42%	+0.23%	+0.03%	+0.41%	+0.07%	+0.16%	0.00%	-0.02%
Décembre	-	-0.56%	+0.07%	+0.16%	+0.08%	-0.10%	+0.05%	+0.22%	-0.19%	+0.39%	+0.42%
Année	+0.18%	-1.34%	-0.52%	+0.66%	+1.81%	+0.70%	+0.89%	+0.09%	+0.24%	+2.12%	+5.04%

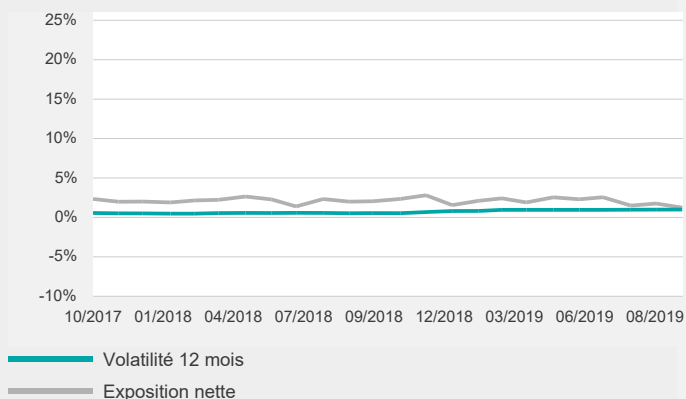
Depuis création

% de mois positifs	68.09%	
Meilleure performance mensuelle	+1.58%	avril 2008
Plus mauvaise performance mensuelle	-1.34%	septembre 2008

Exposition du fonds (en % de l'actif net)

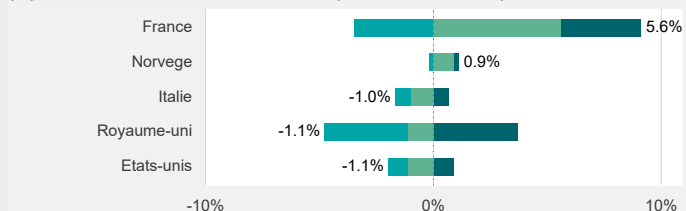
	Capitalisation Boursière < 5 Mds €	Capitalisation Boursière > 5 Mds €
Long	2.6%	25.8%
Short	-1.3%	-25.9%

Volatilité et exposition nette du fonds sur 24 mois

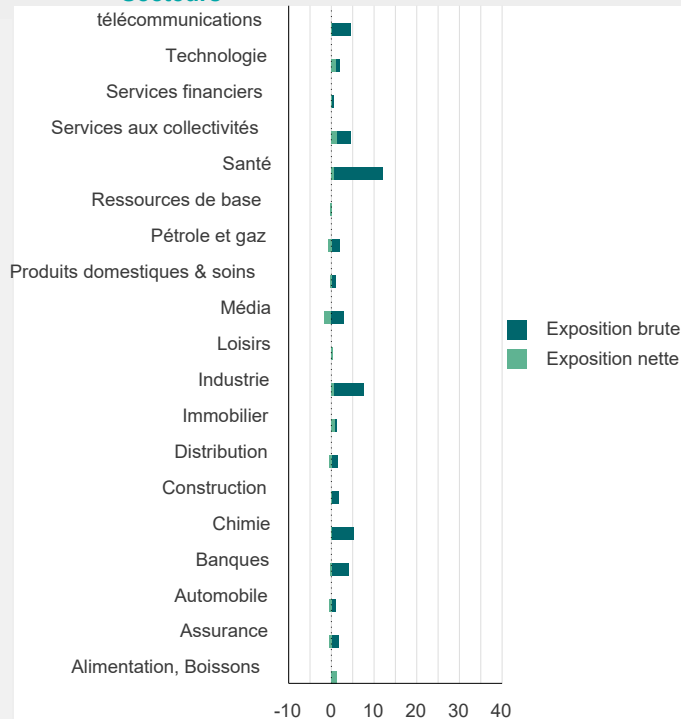


Pays

(top 5 en absolu, net en %, avec décomposition des indices)



Secteurs



Pour plus d'informations : www.exane-am.com

Avertissement : les performances passées ne préjugent pas des performances futures. Tout investissement peut générer des pertes ou des gains. Le présent document informatif ne constitue pas le prospectus du FCP et ne doit pas être considéré comme une offre commerciale, une sollicitation d'investissement ou le support d'un conseil en investissement. Toute souscription dans le FCP ne peut être réalisée que sur la base du prospectus et après avoir pris connaissance du DICI. L'investisseur est invité à se rapporter à la rubrique facteurs de risque du prospectus. Le fonds exane pleiade tresorerie est immatriculé en France. Le prospectus est disponible sur simple demande auprès de la société de gestion. En particulier, ce Fonds d'investissement à vocation générale nourricier ne peut pas être offert ou vendu, directement ou indirectement, aux Etats-Unis au bénéfice ou pour le compte d'une US Person, selon la définition de la "régulation S". Le FCP a été soumis jusqu'au 15 juin 2009 au régime des OPCVM à règles d'investissement allégées sans effet de levier.