

Exane Pleiade Performance Fund (part I, Euro)

Long/short actions market neutral

Univers : Multi-secteurs

Code ISIN : FR0010317784 | Date de lancement : 31 janvier 2007

Gérant : Eric Lauri



Description du fonds

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

Chiffres clés

- Performance mensuelle : **0.33%**
- 2019 : **1.37%**
- VL (€) : **15 389,22**
- Actif net du fonds (Mio €) : **100**
- Encours de la stratégie (Mio €) : **756**

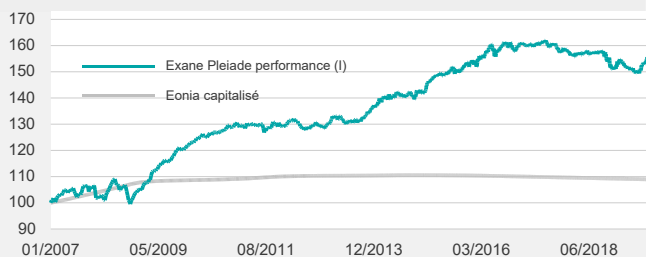
Composition du portefeuille

	LONG	SHORT
Nombre de lignes	84	96
Contribution (bps)	432	-397

	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 performance (I)	-2.37%	-4.01%	-4.18%	9.26%	53.89%
Eonia capitalisé (*)	-0.37%	-0.73%	-1.09%	-1.43%	8.95%
Annualisées					
Exane Pleiade performance (I)	-2.37%	-2.02%	-1.41%	1.79%	3.46%
Eonia capitalisé (*)	-0.37%	-0.37%	-0.36%	-0.29%	0.68%



*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	3.2%	3.5%
Volatilité 12 mois min./max.	1.9% / 4.0%	1.9% / 6.9%
Ratio de sharpe	-0,5	0,8

Contributions*/ expositions

	Exposition brute moyenne	Contribution nette
Santé	64.97%	1.08%
Industrie	36.43%	-0.18%
Services aux collectivités	34.14%	-0.08%
Chimie	31.27%	0.18%
télécommunications	28.86%	-0.01%
Média	19.30%	-0.69%
Banques	16.90%	0.24%
Assurance	11.93%	0.26%
Pétrole et gaz	11.91%	0.04%
Construction	11.89%	-0.03%
Immobilier	4.75%	-0.11%
Distribution	4.59%	-0.23%
Automobile	3.78%	0.03%
Services financiers	3.73%	-0.09%
Technologie	2.07%	-0.13%
Produits domestiques & soins	0.61%	0.08%
Loisirs	0.38%	-0.00%
Alimentation, Boissons	0.00%	0.00%
Ressources de base	0.00%	0.00%
Total	288%	0.33%

Meilleures contributions	Contribution	Poids moyen
SANOFI	0.50%	6.87%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	0.38%	6.51%
NOVARTIS AG-REG	0.23%	-6.00%
IPSEN	0.22%	-2.00%
COVESTRO AG	0.20%	3.38%

Pires contributions	Contribution	Poids moyen
EDF	-0.39%	3.67%
DELIVERY HERO SE	-0.27%	1.69%
MERCK KGAA	-0.26%	-5.66%
WACKER CHEMIE AG	-0.23%	1.37%
PEARSON PLC	-0.23%	1.36%

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

Mouvements acheteurs	
E.ON SE	6.43%
GLAXOSMITHKLINE PLC	4.44%
VEOLIA ENVIRONNEMENT	3.16%
CLARIANT AG-REG	2.85%
VARTA AG	2.24%

Mouvements vendeurs	
SNAM SPA	-4.87%
GIVAUDAN-REG	-4.16%
NOVO NORDISK A/S-B	-4.15%
MERCK & CO. INC.	-4.07%
SUEZ	-3.48%

Exposition du fonds	30 septembre 2019	Moyenne sur 12 mois
Long	163.0%	120.9%
Short	-158.6%	-114.5%
Brute	321.5%	235.4%
Nette/nette ajustée du beta	4.4% / 8.4%	6.4% / 9.4%
Top 5 des positions à l'achat	30.7%	17.1%

Historique des performances

	2019	2018	2017	2016	2015	2014	2013	2012	2011	2010	2009
Janvier	+1.17%	-0.88%	+0.47%	+0.03%	+2.62%	+1.00%	+1.82%	-0.04%	-1.21%	+0.82%	+1.92%
Février	+0.48%	-0.35%	-0.23%	+0.82%	+0.80%	+1.12%	-0.84%	+1.41%	+0.14%	+0.51%	+0.34%
Mars	-1.41%	+0.04%	+0.36%	+0.50%	+0.72%	+0.38%	+0.53%	+0.32%	+0.90%	+1.21%	+3.52%
Avril	-0.42%	-0.13%	-0.54%	+1.26%	+0.77%	-0.12%	-1.48%	-1.12%	-0.32%	+0.33%	+0.98%
Mai	-0.45%	+0.45%	+0.46%	+1.15%	-0.33%	+1.22%	+0.77%	-1.49%	-0.04%	-0.47%	+1.29%
Juin	-0.25%	-0.34%	+0.29%	-1.80%	+0.06%	-1.03%	-0.05%	-0.02%	-0.13%	+0.80%	+1.41%
Juillet	+0.31%	+0.28%	+0.33%	+0.64%	+1.73%	+0.11%	-0.38%	+0.20%	+0.05%	+0.76%	-0.18%
Août	+1.63%	+0.23%	-1.00%	+1.38%	-0.79%	+0.35%	+0.60%	+0.83%	-0.82%	-0.03%	+1.40%
Septembre	+0.33%	+0.14%	+0.32%	+0.22%	-0.11%	-0.39%	+1.00%	+0.08%	0.00%	+0.45%	+2.26%
Octobre	-	-0.48%	-0.86%	+0.19%	+1.20%	+1.19%	+1.03%	-0.70%	+1.14%	+1.08%	+0.35%
Novembre	-	-1.18%	-0.75%	-1.55%	+0.97%	+0.18%	+1.86%	+0.30%	+0.40%	-0.03%	-0.07%
Décembre	-	-2.07%	+0.49%	+0.75%	+0.36%	-0.33%	+0.32%	+0.81%	-0.68%	+1.25%	+1.44%
Année	+1.37%	-4.23%	-0.68%	+3.59%	+8.27%	+3.71%	+5.24%	+0.55%	-0.58%	+6.88%	+15.64%

Depuis création

% de mois positifs	65.13%
Meilleure performance mensuelle	+4.44% avril 2008
Plus mauvaise performance mensuelle	-5.74% septembre 2008

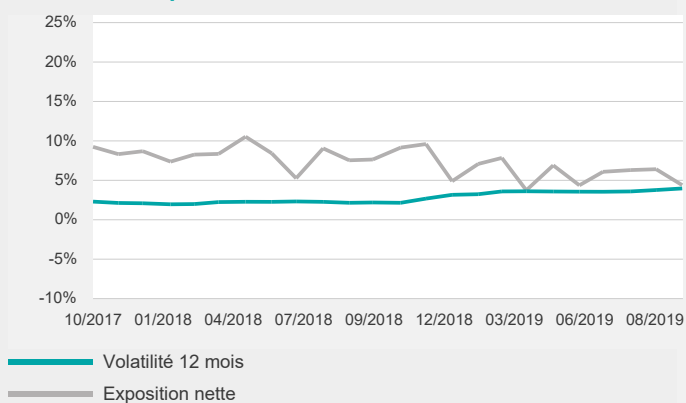
	Stoxx 600*	Pleiade Performance (i)*
Mois en hausse (84)	+3.07%	+0.60%
Mois en baisse (68)	-3.53%	-0.09%

*Performances mensuelles moyennes

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

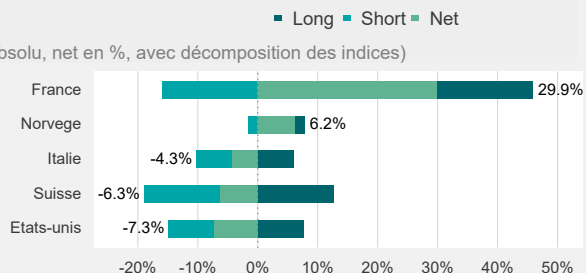
	Capitalisation Boursière < 5 Mds €	Capitalisation Boursière > 5 Mds €
Long	16.9%	146.1%
Short	-7.7%	-150.8%

Volatilité et exposition nette du fonds sur 24 mois

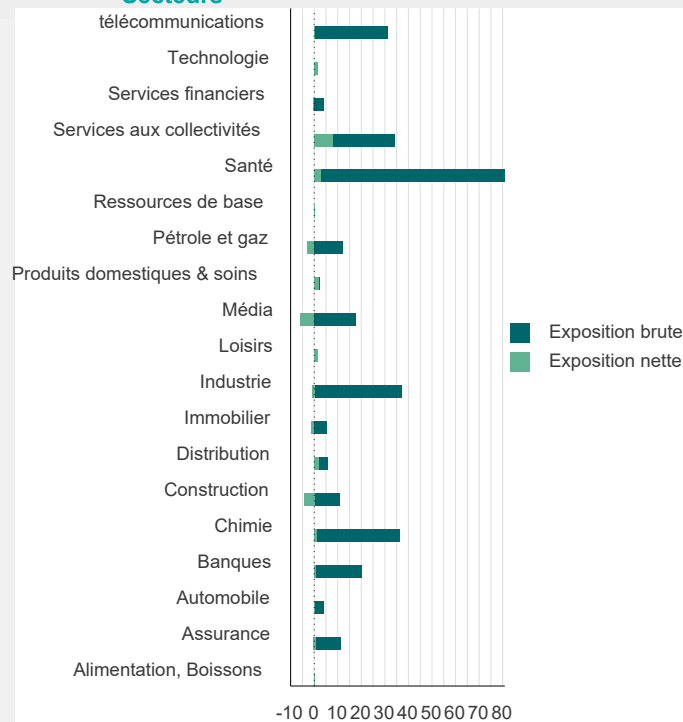


Pays

(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 performance 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.