

DARWIN DIVERSIFIE 0-20 - C

REPORTING

Communication
Publicitaire

31/03/2024

DIVERSIFIÉ ■

Article 8 ■

Données clés (Source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : 117,46 (EUR)

Date de VL et d'actif géré : 28/03/2024

Actif géré : 239,09 (millions EUR)

Code ISIN : FR0010551689

Indice de référence :

5% CAC 40 + 90% ESTR CAPITALISE (OIS) + 5% EURO STOXX 50

Objectif d'investissement

Le fonds est investi en actions et produits de taux de la zone Euro. L'exposition aux marchés actions, comprise entre 0 et 20%, 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 > 3 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	29/02/2024	29/12/2023	31/03/2023	31/03/2021	29/03/2019	31/03/2014	28/12/2007	
Portefeuille	2,25%	1,41%	2,25%	7,90%	5,65%	5,94%	9,98%	17,46%
Indice	1,94%	0,67%	1,94%	5,11%	7,52%	9,16%	11,25%	16,53%
Ecart	0,30%	0,74%	0,30%	2,79%	-1,87%	-3,21%	-1,27%	0,93%

Performances calendaires * (Source : Fund Admin)

	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Portefeuille	8,43%	-5,72%	2,56%	-2,47%	3,82%	-4,54%	2,33%	0,44%	3,15%	0,94%
Indice	5,01%	-0,71%	2,06%	-0,49%	2,27%	-1,35%	0,72%	0,34%	0,92%	0,42%
Ecart	3,41%	-5,01%	0,50%	-1,98%	1,54%	-3,19%	1,61%	0,10%	2,23%	0,52%

* 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	3,74%	3,78%	3,67%
Volatilité de l'indice	1,19%	2,00%	1,97%
Tracking Error ex-post	2,74%	2,38%	2,18%
Ratio d'information	1,17	-0,24	-0,27
Ratio de sharpe	1,33	0,16	0,16

* 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	-8,75%
Délai de recouvrement (jours)	427
Moins bon mois	03/2020
Moins bonne performance	-3,90%
Meilleur mois	01/2023
Meilleure performance	3,00%

Indicateurs (Source : Amundi)

	Portefeuille	Indice
Sensibilité	2,56	0,00
Nombre de lignes	30	73

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

DIVERSIFIÉ ■

Commentaire de gestion

Les chiffres économiques publiés en mars ont confirmé la bonne tenue de l'économie américaine et une très légère amélioration en Europe à partir d'une situation de quasi-stagnation. Le ralentissement de l'inflation a continué, mais de façon plus graduelle que fin 2023.

Dans ce contexte, les actions ont poursuivi leur ascension.

Ainsi sur le mois le CAC 40 termine à +3.59%, l'Eurostoxx 50 progresse de +4.33%, le S&P 500 en \$ de +3.18% et le MSCI Emergent en \$ de +2.20%. Au niveau sectoriel, les valeurs dites cycliques (+4,3%) surperforment les valeurs défensives (+3,5%). En tête, le secteur bancaire (+9,1%), le secteur de l'immobilier (+8,2%) et le secteur de l'énergie (+6,8%).

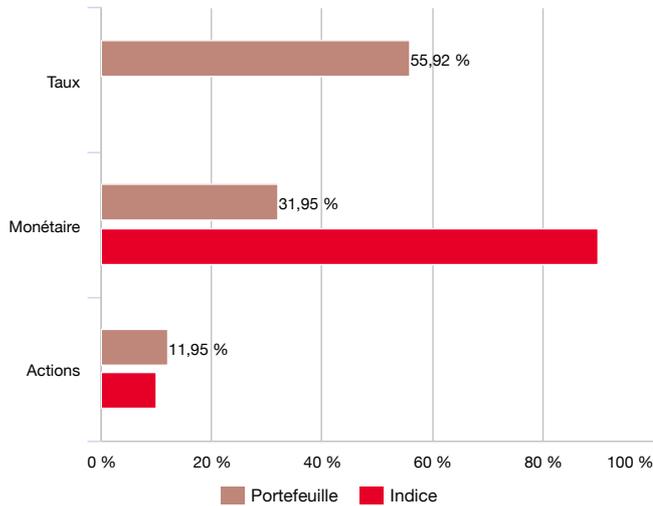
Du côté obligataire, après 2 mois de hausse, les taux ont stoppé leur progression. Le rendement du Bund allemand à dix ans a baissé de 11 pbs pour s'établir à 2,3% tandis que le 10 ans US termine le mois à 4.2% en recul de 5pbs.

La forte hausse des marchés actions nous a permis, conformément au processus d'allocation systématique, de sécuriser en milieu de mois une partie de nos bénéfices en réduisant l'exposition actions lorsque les performances du CAC 40 et de l'Eurostoxx 50 ont dépassé les 10% depuis leurs niveaux de début d'année.

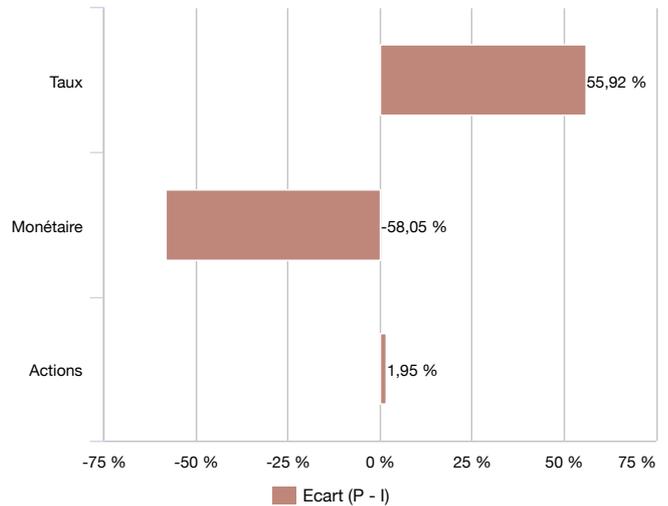
Le fonds a surperformé son indice sur le mois, aidé à la fois par sa sur exposition globale aux actions et par la bonne performance des obligations « haut rendement ».

Composition du portefeuille (Source : Amundi)

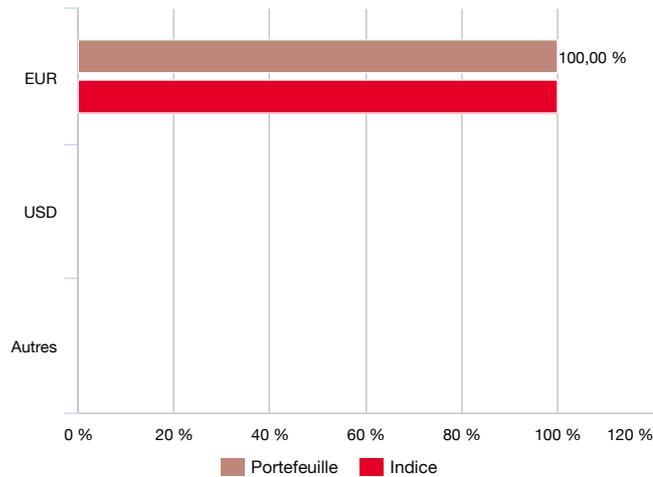
Allocation d'actifs (Source : Amundi)



Allocation d'actifs en relatif (Source : Amundi)



Répartition par devises (Source : Groupe Amundi)



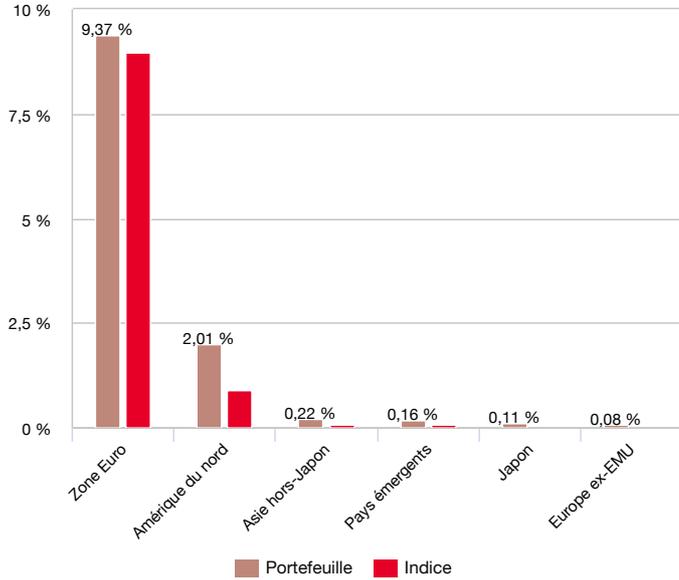
Principales lignes en portefeuille (Source : Amundi)

Ligne	Portefeuille (%)
A-F EURO CORPORATE BOND ESG - Z EUR	15,35%
AMUNDI ABS - IC	12,85%
A-F EURO AGGREGATE BOND-Z EUR	12,12%
AMUNDIEuro GovtTLTD GRN Bd UCITS ETFAcc	8,51%
AMUNDI SHORT TERM CREDIT	4,50%
CPR INVEST - CREDIXX GLOB HI YIELD	4,00%
SG MONET PLUS-I	3,81%
AMUNDI EURO LIQUIDITY SRI - Z (C)	3,81%
A-F MONTPENSIER GL CONV BOND - Z	3,80%
A-F EURO SUB BOND ESG-Z EUR	3,50%

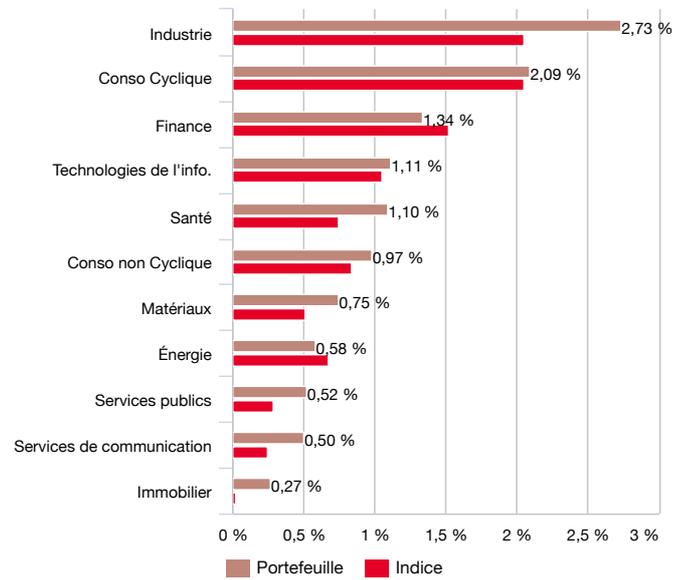
DIVERSIFIÉ ■

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

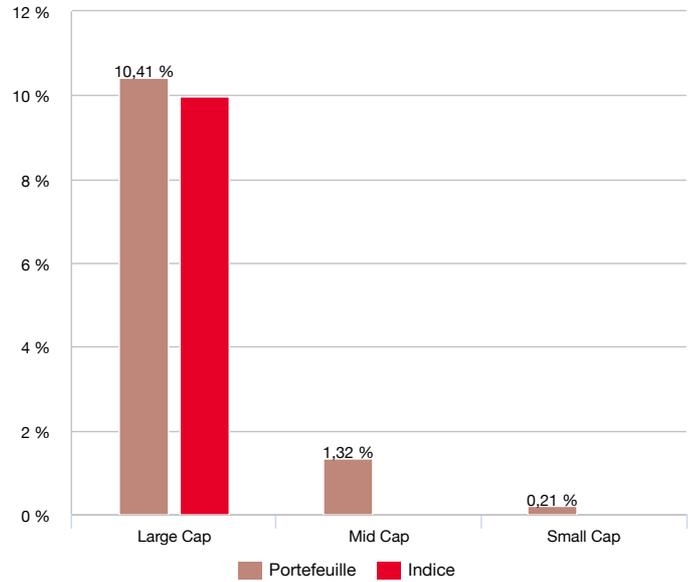
Répartition par zones géographiques (Source : Amundi)



Répartition par secteurs (Source : Amundi)



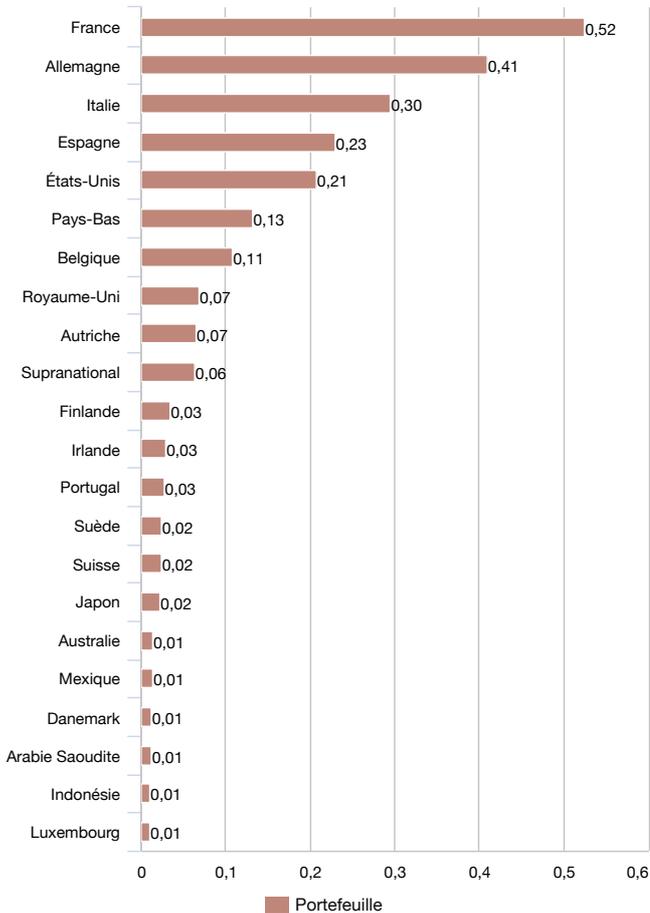
Répartition par capitalisations boursières (Source : Amundi)



Composition du portefeuille - Analyse des obligations et du monétaire (Source : Amundi)

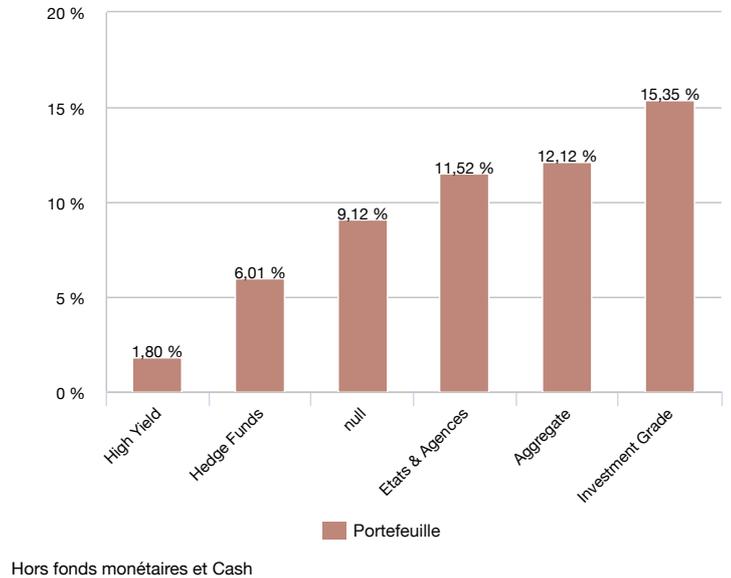
Répartition par pays (Source : Amundi)

En points de sensibilité



Répartition par types émetteurs (Source : Amundi)

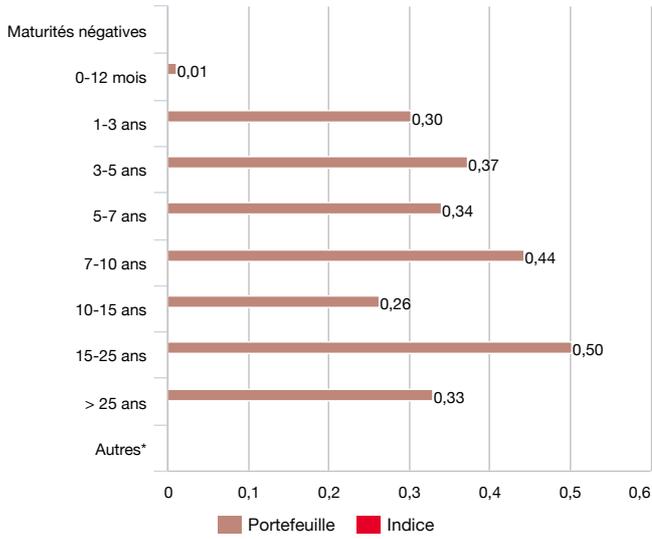
En % d'actif



DIVERSIFIÉ ■

Répartition par maturités (Source : Amundi) *

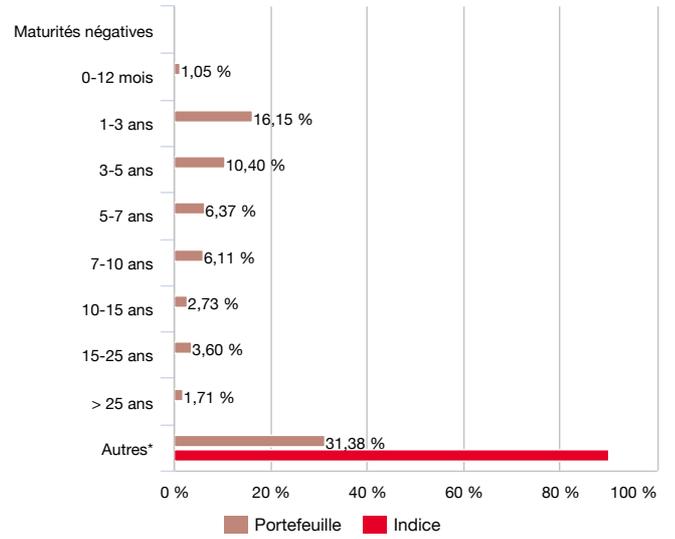
En points de sensibilité



** Autres : non classés, deposits, appels de marge ...

Répartition par maturités (Source : Amundi) *

En % d'actif



** Autres : non classés, deposits, appels de marge ...

DIVERSIFIÉ ■

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	FR0010551689
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 courants	1,12% (prélevés) - 31/12/2021
Durée minimum d'investissement recommandée	> 3 ans
Historique de l'indice de référence	30/11/2021 : 90.00% ESTR CAPITALISE (OIS) + 5.00% EURO STOXX 50 + 5.00% CAC 40 01/09/2010 : 90.00% EONIA CAPITALISE (O.I.S.) (BASE 360) - DISCONTINUED + 5.00% EURO STOXX 50 + 5.00% CAC 40 28/12/2007 : 90.00% EONIA CAPITALISE + 5.00% EURO STOXX 50 + 5.00% CAC 40

Avertissement

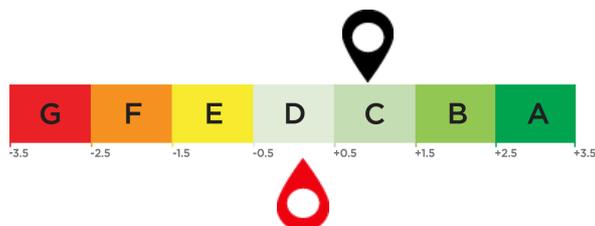
Document simplifié et non contractuel, destiné à être remis exclusivement aux porteurs de parts. Les caractéristiques principales du fonds sont mentionnées dans sa documentation juridique, disponible sur le site de l'AMF ou sur simple demande au siège social de la société de gestion. La documentation 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.

DIVERSIFIÉ ■

NOTE ESG MOYENNE (source : Amundi)

Notation environnementale, sociale et de gouvernance

Univers d'investissement ESG: 90% INDEX AMUNDI ESG RATING D + 5% CAC 40 + 5% EURO STOXX 50



Score du portefeuille d'investissement: 0,90

Score de l'univers d'investissement ESG¹: 0,11

Couverture ESG (source : Amundi)

	Portefeuille	Univers d'investissement ESG
Pourcentage avec une notation ESG Amundi ²	98,35%	100,00%
Pourcentage pouvant bénéficier d'une notation ESG ³	98,35%	100,00%

Lexique ESG

Critères ESG

Il s'agit de critères extra-financiers utilisés pour évaluer les pratiques Environnementales, Sociales et la Gouvernance des entreprises, Etats ou collectivités :

- « E » pour Environnement (niveau de consommation d'énergie et de gaz, gestion de l'eau et des déchets...).
- « S » pour Social/Sociétal (respect des droits de l'homme, santé et sécurité au travail...).
- « G » pour Gouvernance (indépendance du conseil d'administration, respect des droits des actionnaires ...).

Notes ESG

Note ESG de l'émetteur : chaque émetteur est évalué sur la base de critères ESG et obtient un score quantitatif dont l'échelle est basée sur la moyenne du secteur. Le score est traduit en note sur une échelle allant de A (le meilleur niveau) à G (le moins bon). La méthodologie d'Amundi permet une analyse exhaustive, standardisée et systématique des émetteurs sur l'ensemble des régions d'investissements et des classes d'actifs (actions, obligations, etc.).

Note ESG de l'univers d'investissement et du portefeuille: le portefeuille et l'univers d'investissement se voient attribuer un score ESG et une note ESG (de A à G). Le score ESG correspond à la moyenne pondérée des scores des émetteurs, calculée en fonction de leur pondération relative dans l'univers d'investissement ou dans le portefeuille, hors actifs liquides et émetteurs non notés.

Intégration de l'ESG chez Amundi

En plus de se conformer à la politique d'investissement responsable d'Amundi⁴, les portefeuilles d'Amundi intégrant l'ESG ont un objectif de performance ESG qui vise à atteindre un score ESG pour leur portefeuille supérieur au score ESG de leur univers d'investissement ESG.

¹ La référence à l'univers d'investissement est définie par l'indicateur de référence du fonds ou par un indice représentatif de l'univers ESG investissable.

² Pourcentage de titres du portefeuille total ayant une note Amundi ESG (en termes de pondération)

³ Pourcentage de titres du portefeuille total pour lesquels une méthodologie de notation ESG est applicable (en termes de pondération).

⁴ Le document mis à jour est disponible à l'adresse <https://www.amundi.com/int/ESG>.

Niveau de durabilité (source : Morningstar)

Le fonds n'est pas encore noté par Morningstar

Le niveau de durabilité est une notation produite par la société Morningstar qui vise à mesurer le niveau de responsabilité d'un fonds de façon indépendante sur la base des valeurs en portefeuille. La notation s'établit de très faible (un globe) à très élevé (5 globes). L'obtention de cette notation par le compartiment ne signifie pas que celui-ci réponde à vos propres objectifs en matière de durabilité.

Source Morningstar ©

Sustainability Score – sur la base des analyses de risques ESG fournies par Sustainalytics sur les entreprises, utilisées dans le calcul du score de durabilité de Morningstar.

© 2024 Morningstar. Tous droits réservés. Les informations contenues ici : (1) appartiennent à Morningstar et/ou ses fournisseurs de contenu ; (2) ne peuvent être reproduites ou redistribuées ; et (3) ne sont pas garanties d'exactitude, d'exhaustivité ou d'actualité. Ni Morningstar, ni ses fournisseurs de contenu ne sont responsables en cas de dommages ou de pertes liés à l'utilisation de ces informations. Les performances passées ne garantissent pas les résultats futurs. Pour plus d'informations sur le rating Morningstar, veuillez consulter leur site www.morningstar.com.