DARWIN DIVERSIFIE 60-80 - C

REPORTING

Communication Publicitaire

31/03/2024

DIVERSIFIÉ ■

Données clés (Source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : **143,15 (EUR)**

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

Actif géré : **94,15 (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)*

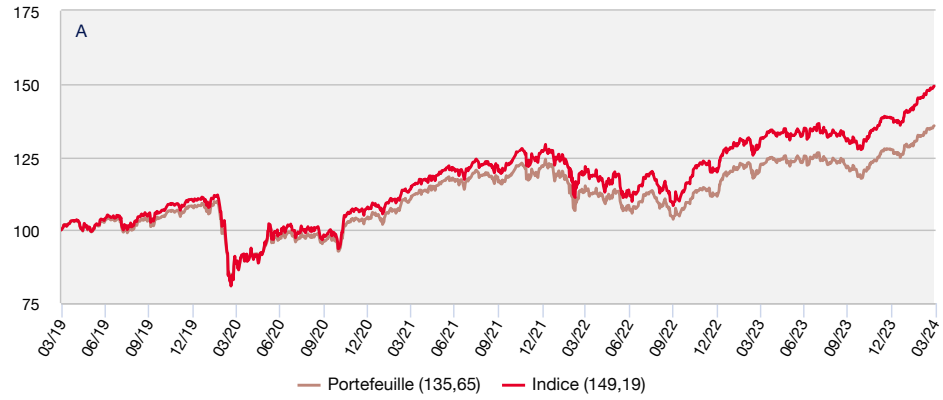
1 2 3 **4** 5 6 7

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 29/12/2023	1 mois 29/02/2024	3 mois 29/12/2023	1 an 31/03/2023	3 ans 31/03/2021	5 ans 29/03/2019	10 ans 31/03/2014	Depuis le 28/12/2007
Portefeuille	6,36%	2,81%	6,36%	10,73%	21,95%	35,65%	53,23%	43,15%
Indice	7,85%	2,86%	7,85%	13,50%	30,06%	49,19%	79,36%	60,49%
Ecart	-1,49%	-0,05%	-1,49%	-2,78%	-8,11%	-13,54%	-26,13%	-17,34%

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%

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

	1 an	3 ans	5 ans
Volatilité du portefeuille	7,96%	12,17%	12,09%
Volatilité de l'indice	7,98%	13,13%	13,19%
Tracking Error ex-post	1,08%	1,90%	2,04%
Ratio d'information	-2,70	-1,19	-1,01
Ratio de sharpe	1,19	0,47	0,48

* 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	59	73

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

* 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.

DARWIN DIVERSIFIE 60-80 - C

REPORTING

Communication Publicitaire
31/03/2024

DIVERSIFIÉ ■

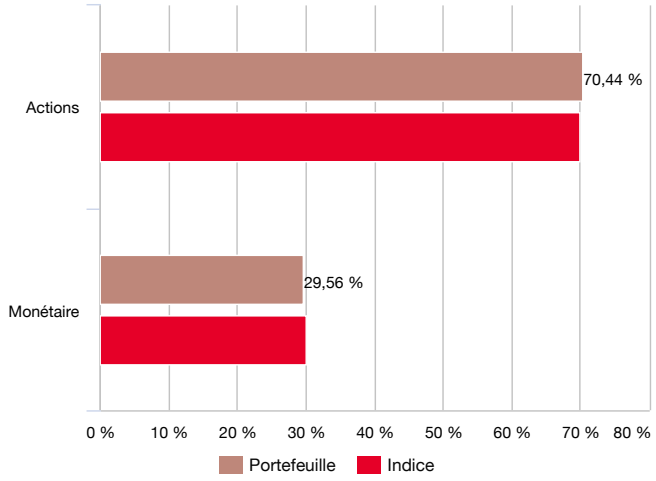
Commentaire de gestion

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 coté 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.

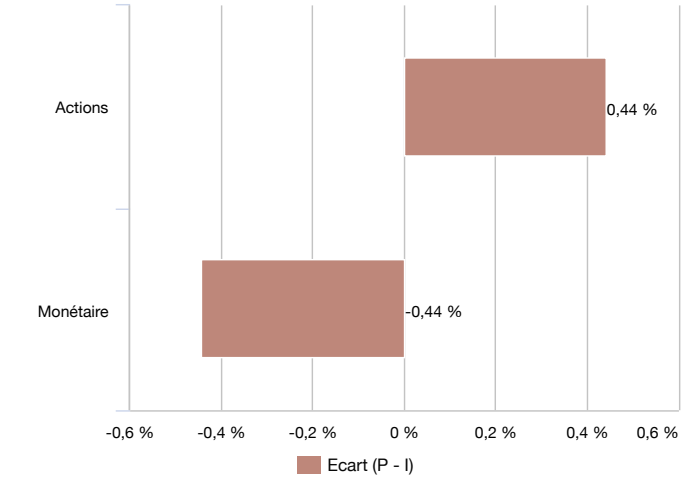
La forte hausse des marchés actions nous a permis, conformément au processus d'allocation systématique, de sécuriser en milieu de mois une partie de nos bénéfices en réduisant l'exposition actions lorsque les performances du CAC 40 et de l'Eurostoxx 50 ont dépassé les 10% depuis leurs niveaux de début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

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	16,93%
AMUNDI PEA COURT TERME	10,95%
SG ACT EURO SELECTION	8,06%
AMUNDI SERENITE PEA-I(C)	7,92%
SG VALOR ALPHA ACT.FRA.Z FCP	5,72%
AMUNDI FRANCE ENGAGEMENT-Z (C)	5,65%
AMUNDI ACT FRA ISR-Z (C)	4,96%
SG ACT FRANCE - C	4,05%
AMND EURO STX 50 ETF(PAR)	3,32%
AMUNDI CAC 40 UCITS ETF DR - EUR (C)	2,76%

DARWIN DIVERSIFIE 60-80 - C

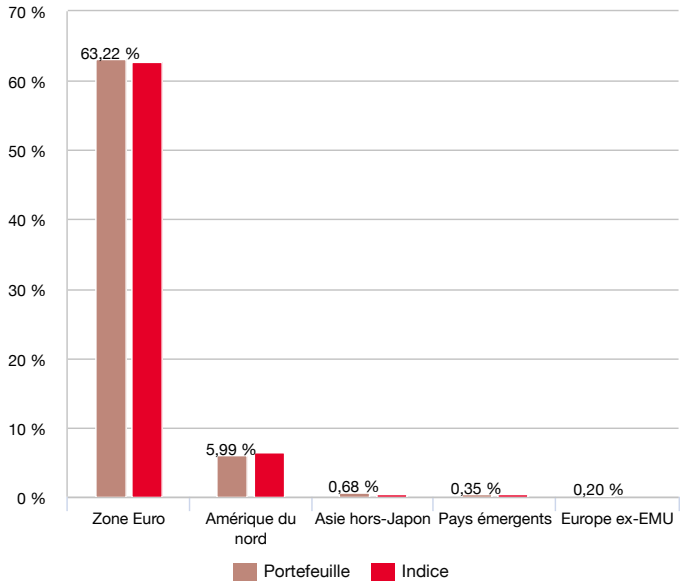
REPORTING

Communication Publicitaire
31/03/2024

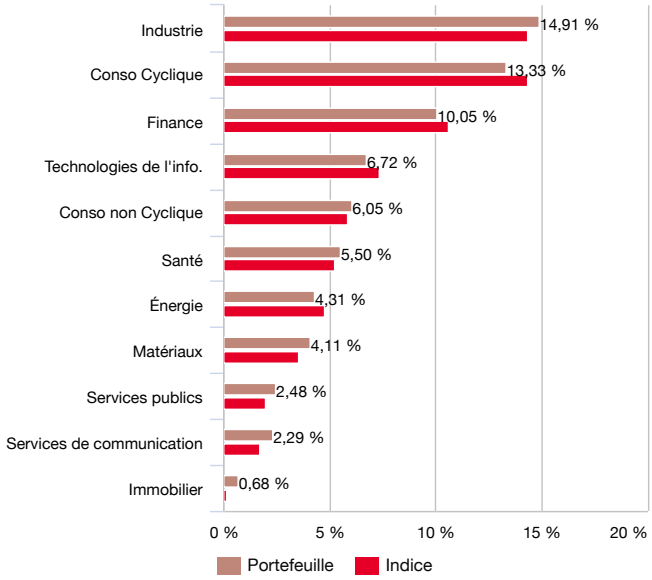
DIVERSIFIÉ ■

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

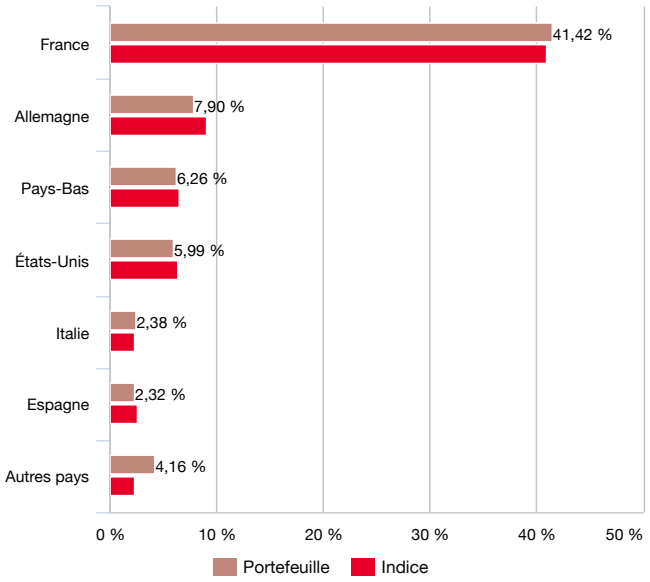
Répartition par zones géographiques (Source : Amundi)



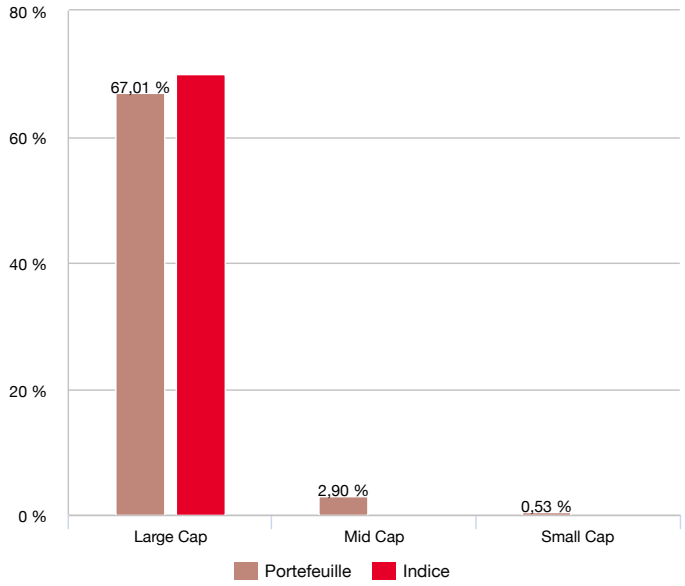
Répartition par secteurs (Source : Amundi)



Répartition par pays (Source : Amundi)



Répartition par capitalisations boursières (Source : Amundi)



DARWIN DIVERSIFIE 60-80 - C

REPORTING

Communication Publicitaire
31/03/2024

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	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 courants	1,96% (prélevés) - 31/12/2021
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.