

# 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 : **0.03%**
- 2022 : **1.31%**
- VL (€) : **18 984,77**
- Actif net du fonds (Mio €) : **120**

## Composition du portefeuille

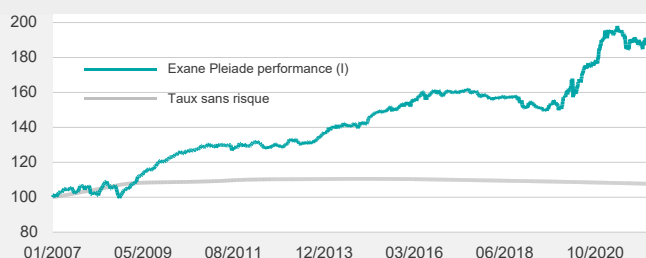
|                    | LONG   | SHORT |
|--------------------|--------|-------|
| Nombre de lignes   | 88     | 113   |
| Contribution (bps) | -483.2 | 484.8 |

|  | Top 5 (poids)    | Top 5 (poids)      |
|--|------------------|--------------------|
|  | Enel             | Terna              |
|  | Engie            | Sonova (ex Phonak) |
|  | BP               | Novartis R         |
|  | Roche Holding AG | ENI SpA            |
|  | Repsol SA        | E.On               |

## Performances

|                               | 12 mois | 2 ans  | 3 ans  | 5 ans  | Depuis création |
|-------------------------------|---------|--------|--------|--------|-----------------|
| <b>Cumulées</b>               |         |        |        |        |                 |
| Exane Pleiade performance (I) | -2.71%  | 16.87% | 23.02% | 18.66% | 89.85%          |
| Taux sans risque (*)          | -0.51%  | -0.97% | -1.38% | -2.10% | 7.68%           |
| <b>Annualisées</b>            |         |        |        |        |                 |
| Exane Pleiade performance (I) | -2.71%  | 8.10%  | 7.14%  | 3.48%  | 4.34%           |
| Taux sans risque (*)          | -0.51%  | -0.49% | -0.46% | -0.42% | 0.49%           |



(\*) Le fonds cherche à restituer une performance absolue, régulière et décorrélée des marchés. Le taux sans risque ne constitue pas l'indicateur de référence du fonds. Jusqu'au 31/12/2021, le taux sans risque était l'indice EONIA capitalisé. Depuis le 01/01/2022, l'indice EONIA est remplacé par l'indice ESTER et les performances sont présentées selon la méthode du chaînage.

## Risques

|                              | 2 ans       | Depuis création |
|------------------------------|-------------|-----------------|
| Volatilité                   | 6.8%        | 4.1%            |
| Volatilité 12 mois min./max. | 4.1% / 7.9% | 1.9% / 7.9%     |
| Ratio de sharpe              | 1,3         | 0,9             |

## Contributions\*/ expositions

|                                                   | Exposition brute moyenne | Contribution nette |
|---------------------------------------------------|--------------------------|--------------------|
| Santé                                             | 45.68%                   | -4.01%             |
| Services aux collectivités                        | 38.21%                   | 2.90%              |
| Industries et construction                        | 37.68%                   | 0.82%              |
| Energie                                           | 37.30%                   | 2.49%              |
| Chimie                                            | 26.67%                   | -1.86%             |
| Banques                                           | 24.90%                   | 0.05%              |
| Technologie                                       | 18.33%                   | -0.78%             |
| Services financiers                               | 12.65%                   | 0.68%              |
| Assurances                                        | 7.80%                    | -0.31%             |
| Immobilier                                        | 6.41%                    | -0.23%             |
| Autos et Equipements                              | 6.23%                    | 0.47%              |
| Produits ménagers et personnels                   | 5.01%                    | 0.69%              |
| Distribution                                      | 4.78%                    | -0.68%             |
| Produits de consommation durable                  | 1.93%                    | -0.05%             |
| Médias                                            | 1.11%                    | -0.05%             |
| Sociétés de services personnels et professionnels | 0.92%                    | -0.07%             |
| Agroalimentaire et boissons                       | 0.61%                    | -0.03%             |
| Ressources de base                                | 0.02%                    | 0.01%              |
| Telecoms                                          | 0.00%                    | 0.00%              |
| <b>Total</b>                                      | <b>276.21%</b>           | <b>0.03%</b>       |

| Meilleures contributions | Contribution | Poids moyen |
|--------------------------|--------------|-------------|
| OMV AG                   | 1.03%        | -4.98%      |
| THALES SA                | 0.67%        | 2.31%       |
| FORTUM OYJ               | 0.46%        | -1.09%      |
| TOTALENERGIES SE         | 0.35%        | -3.44%      |
| E.ON SE                  | 0.33%        | -0.05%      |

| Pires contributions   | Contribution | Poids moyen |
|-----------------------|--------------|-------------|
| GN STORE NORD A/S     | -0.47%       | 3.78%       |
| SONOVA HOLDING AG-REG | -0.45%       | -5.09%      |
| EQUINOR ASA           | -0.40%       | -2.78%      |
| ERICSSON LM-B SHS     | -0.38%       | 1.82%       |
| BAE SYSTEMS PLC       | -0.38%       | -1.51%      |

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

|              | Mouvements acheteurs |
|--------------|----------------------|
| IBERDROLA SA | 6.89%                |
| SNAM SPA     | 4.16%                |
| RWE AG       | 3.61%                |
| GIVAUDAN-REG | 3.51%                |
| MERCK KGAA   | 2.88%                |

|                              | Mouvements vendeurs |
|------------------------------|---------------------|
| E.ON SE                      | -12.27%             |
| ALCON INC                    | -4.32%              |
| NOVO NORDISK A/S-B           | -3.79%              |
| HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF | -2.42%              |
| SHELL PLC                    | -2.37%              |

| Exposition du fonds           | 28 février 2022 | Moyenne sur 12 mois |
|-------------------------------|-----------------|---------------------|
| Long                          | 138.9%          | 150.2%              |
| Short                         | -136.7%         | -142.9%             |
| Brute                         | 275.6%          | 293.1%              |
| Nette/nette ajustée du beta   | 2.2% / 11.1%    | 7.3% / 13.0%        |
| Top 5 des positions à l'achat | 33.8%           | 33.7%               |

## Historique des performances

|              | 2022          | 2021          | 2020           | 2019          | 2018          | 2017          | 2016          | 2015          | 2014          | 2013          | 2012          |
|--------------|---------------|---------------|----------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|
| Janvier      | +1.29%        | +1.19%        | +2.55%         | +1.17%        | -0.88%        | +0.47%        | +0.03%        | +2.62%        | +1.00%        | +1.82%        | -0.04%        |
| Février      | +0.03%        | +1.03%        | +0.62%         | +0.48%        | -0.35%        | -0.23%        | +0.82%        | +0.80%        | +1.12%        | -0.84%        | +1.41%        |
| Mars         | -             | -0.90%        | -0.90%         | -1.41%        | +0.04%        | +0.36%        | +0.50%        | +0.72%        | +0.38%        | +0.53%        | +0.32%        |
| Avril        | -             | +2.43%        | +2.08%         | -0.42%        | -0.13%        | -0.54%        | +1.26%        | +0.77%        | -0.12%        | -1.48%        | -1.12%        |
| Mai          | -             | -1.75%        | +0.86%         | -0.45%        | +0.45%        | +0.46%        | +1.15%        | -0.33%        | +1.22%        | +0.77%        | -1.49%        |
| Juin         | -             | -1.38%        | +4.96%         | -0.25%        | -0.34%        | +0.29%        | -1.80%        | +0.06%        | -1.03%        | -0.05%        | -0.02%        |
| Juillet      | -             | -3.71%        | +0.69%         | +0.31%        | +0.28%        | +0.33%        | +0.64%        | +1.73%        | +0.11%        | -0.38%        | +0.20%        |
| Août         | -             | +3.03%        | -0.09%         | +1.63%        | +0.23%        | -1.00%        | +1.38%        | -0.79%        | +0.35%        | +0.60%        | +0.83%        |
| Septembre    | -             | -0.17%        | +0.72%         | +0.33%        | +0.14%        | +0.32%        | +0.22%        | -0.11%        | -0.39%        | +1.00%        | +0.08%        |
| Octobre      | -             | -0.50%        | +0.69%         | -1.35%        | -0.48%        | -0.86%        | +0.19%        | +1.20%        | +1.19%        | +1.03%        | -0.70%        |
| Novembre     | -             | -0.58%        | +5.27%         | -0.32%        | -1.18%        | -0.75%        | -1.55%        | +0.97%        | +0.18%        | +1.86%        | +0.30%        |
| Décembre     | -             | -0.35%        | +2.15%         | +4.03%        | -2.07%        | +0.49%        | +0.75%        | +0.36%        | -0.33%        | +0.32%        | +0.81%        |
| <b>Année</b> | <b>+1.31%</b> | <b>-1.83%</b> | <b>+21.24%</b> | <b>+3.70%</b> | <b>-4.23%</b> | <b>-0.68%</b> | <b>+3.59%</b> | <b>+8.27%</b> | <b>+3.71%</b> | <b>+5.24%</b> | <b>+0.55%</b> |

### Depuis création

|                                     |                       |
|-------------------------------------|-----------------------|
| % de mois positifs                  | 64.09%                |
| Meilleure performance mensuelle     | +5.27% novembre 2020  |
| Plus mauvaise performance mensuelle | -5.74% septembre 2008 |

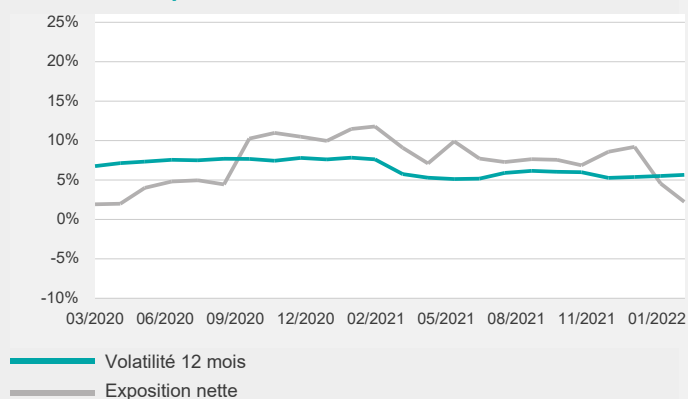
|                     | Stoxx 600* | Pleiade Performance (i)* |
|---------------------|------------|--------------------------|
| Mois en hausse (77) | +2.93%     | +0.51%                   |
| Mois en baisse (53) | -3.61%     | +0.56%                   |

\*Performances mensuelles moyennes

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

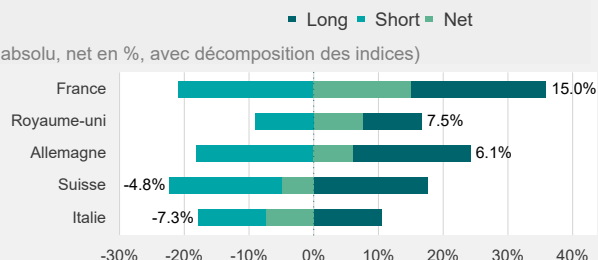
|       | Capitalisation Boursière < 5 Mds € | Capitalisation Boursière > 5 Mds € |
|-------|------------------------------------|------------------------------------|
| Long  | 5.1%                               | 133.8%                             |
| Short | -5.4%                              | -131.3%                            |

### Volatilité et exposition nette du fonds sur 24 mois

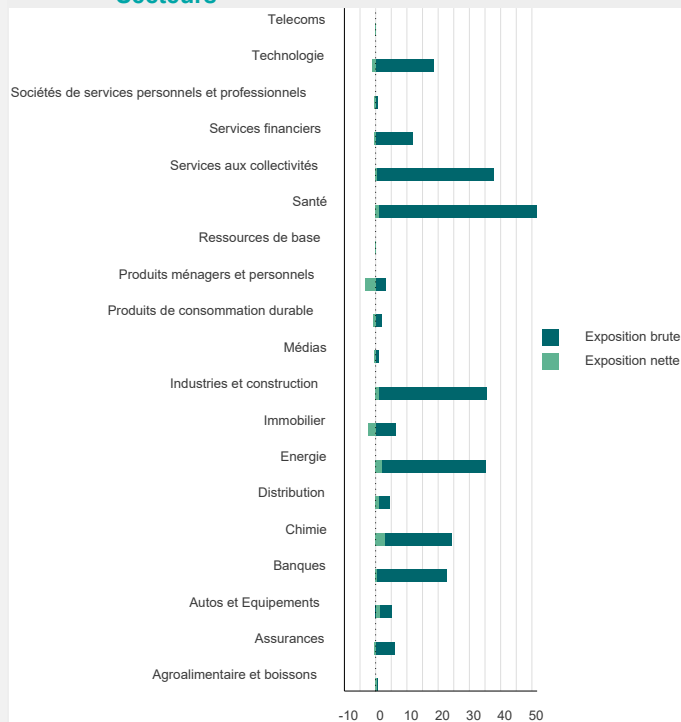


### Pays

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



### Secteurs



Pour plus d'informations : [www.exane-am.com](http://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.