

Exane Overdrive Fund

(part A, Dollar)

Long/short actions market neutral



Univers : Multi-secteurs

Code ISIN : LU0923609118 | Date de lancement : 10 septembre 2014

Gérant : Eric Lauri

Description du fonds / Faits marquants du mois

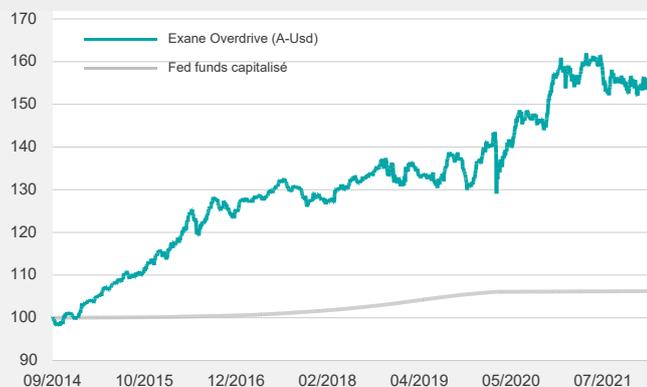
Le fonds Exane Overdrive cherche à réaliser une performance absolue et décorrélée des marchés financiers à travers une gestion dynamique. La sélection de titres s'appuie sur le savoir-faire historique des spécialistes sectoriels couplé à une optimisation quantitative ajustée du risque.

Chiffres clés

- ▶ Performance mensuelle : **-1.30%**
- ▶ 2022 : **-0.81%**
- ▶ VL (€) : **15 318,91**
- ▶ Actif net du fonds (Mio €) : **240**

Performances

	12 mois	2 ans	3 ans	5 ans	Depuis création
Cumulées					
Exane Overdrive (A-usd)	-2.05%	9.31%	12.76%	20.15%	53.19%
Fed funds capitalisé (*)	0.07%	0.20%	2.26%	5.53%	6.23%
Annualisées					
Exane Overdrive (A-usd)	-2.05%	4.54%	4.08%	3.74%	5.87%
Fed funds capitalisé (*)	0.07%	0.10%	0.75%	1.08%	0.81%



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

Risques

	2 ans	Depuis création
Volatilité	8.0%	6.0%
Volatilité 12 mois min./max.	5.7% / 9.6%	3.3% / 9.6%
Ratio de sharpe	0,6	1,0

Contributions / expositions

	Exposition brute moyenne	Contribution nette
Agroalimentaire et boissons	25.10%	-0.09%
Assurances	8.18%	0.07%
Autos et Equipements	16.36%	0.38%
Banques	27.50%	0.51%
Chimie	30.46%	-0.50%
Distribution	11.67%	-0.25%
Energie	34.07%	-0.70%
Immobilier	13.89%	-0.30%
Industries et construction	61.19%	-0.30%
Médias	5.69%	-0.04%
Produits de consommation durable	15.26%	-0.35%
Produits ménagers et personnels	8.72%	0.35%
Ressources de base	0.56%	-0.03%
Santé	45.85%	-0.87%
Services aux collectivités	31.43%	0.95%
Services financiers	17.65%	0.14%
Sociétés de services personnels et professionnels	14.63%	0.13%
Technologie	27.64%	-0.51%
Telecoms	0.27%	0.00%
Total	396.10%	-1.42%

Meilleures contributions	Contribution alpha	Poids moyen
THALES SA	0.66%	2.23%
FORTUM OYJ	0.47%	-1.08%
TOTALENERGIES SE	0.39%	-4.15%
RHEINMETALL AG	0.29%	0.42%
E.ON SE	0.29%	-0.38%

Pires contributions	Contribution alpha	Poids moyen
OMV AG	-0.69%	-4.79%
ALSTOM	-0.65%	3.50%
GN STORE NORD A/S	-0.47%	3.78%
BAE SYSTEMS PLC	-0.45%	-1.74%
EQUINOR ASA	-0.40%	-2.82%

Mouvements acheteurs	
IBERDROLA SA	+ 5.04%
RWE AG	+ 3.64%
GIVAUDAN-REG	+ 3.47%
SIEMENS AG-REG	+ 2.97%
MERCK KGAA	+ 2.90%

Mouvements vendeurs	
E.ON SE	-9.39%
ALCON INC	-4.19%
NOVO NORDISK A/S-B	-3.88%
KERING	-2.52%
SHELL PLC	-2.49%

Exposition du fonds	28 février 2022	Moyenne sur 12 mois
Long	195.6%	206.6%
Short	-192.3%	-204.1%
Brute	387.9%	410.7%
Nette/nette ajustée du beta	3.2% / 9.1%	2.4% / 6.2%
Top 5 des positions à l'achat	25.8%	25.7%

Historique des performances

	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Janvier	+0.49%	-1.20%	+3.18%	+1.39%	-1.10%	+1.83%	+0.39%	+2.90%	-
Février	-1.30%	-0.01%	-0.71%	+0.87%	+0.37%	+0.15%	+1.01%	+0.77%	-
Mars	-	-0.16%	-2.85%	-1.75%	+1.61%	+0.69%	+1.40%	+0.55%	-
Avril	-	+3.72%	+2.33%	+0.03%	+0.03%	-0.66%	+2.46%	+2.42%	-
Mai	-	-0.52%	+0.64%	-0.25%	+1.66%	+1.54%	+2.52%	+0.07%	-
Juin	-	-0.94%	+5.59%	-0.47%	-0.62%	+1.16%	-3.02%	+0.90%	-
Juillet	-	-4.16%	-0.44%	+2.24%	+0.86%	+0.70%	+1.35%	+2.04%	-
Août	-	+2.82%	-0.36%	+2.12%	+0.81%	-1.59%	+3.48%	-0.80%	-
Septembre	-	-1.37%	-0.40%	-1.02%	+1.01%	+0.52%	+0.46%	+0.62%	-
Octobre	-	-0.30%	-0.55%	-3.22%	+1.07%	-1.83%	+0.16%	+1.01%	+1.72%
Novembre	-	+0.42%	+6.25%	-0.54%	-0.23%	-0.65%	-2.25%	+1.53%	+1.00%
Décembre	-	-0.56%	+2.42%	+3.76%	-2.34%	+1.24%	+0.59%	+1.79%	-0.65%
Année	-0.81%	-2.44%	+15.72%	+2.98%	+3.10%	+3.06%	+8.69%	+14.66%	+0.33%

Depuis création

% de mois positifs	61.80%	
Meilleure performance mensuelle	+6.25%	novembre 2020
Plus mauvaise performance mensuelle	-4.16%	juillet 2021

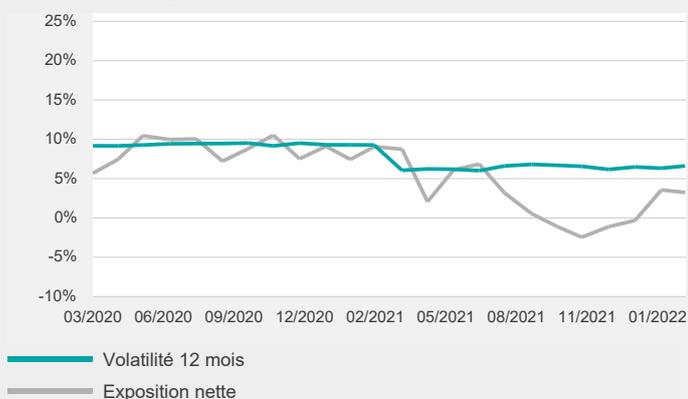
	Stoxx 600*	Overdrive (a-usd)*
Mois en hausse (51)	+3.13%	+0.71%
Mois en baisse (39)	-3.18%	+0.20%

*Performances mensuelles moyennes

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

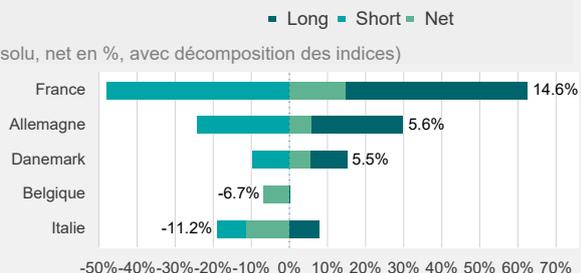
	Capitalisation Boursière < 5 Mds €	Capitalisation Boursière > 5 Mds €
Long	6.4%	189.1%
Short	-8.1%	-184.3%

Volatilité et exposition nette du fonds sur 24 mois

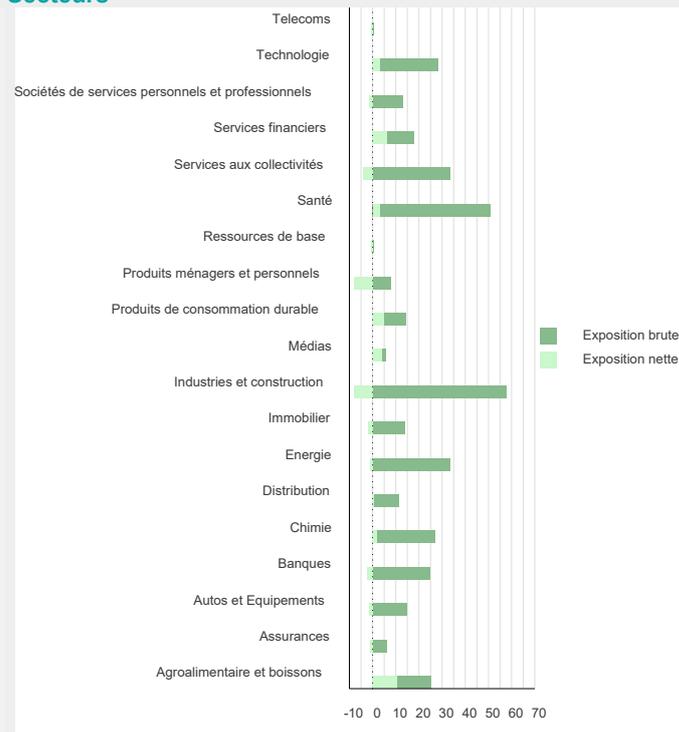


Pays

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



Secteurs



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

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 de la SICAV 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 la SICAV ne peut être réalisée que sur la base du prospectus et après avoir pris connaissance du DICI. L'investisseur est invité à se reporter à la rubrique facteurs de risques du prospectus. Exane overdrive fund est immatriculé au Luxembourg et enregistré pour la commercialisation en France et en Suisse. En particulier, cet OPCVM 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 Représentant et Service de Paiements du Fonds en Suisse : BNP Paribas Securities Services, Paris, succursale de Zurich, Selnaustrasse 16, 8002 Zurich, Suisse. Le règlement, le prospectus, les documents d'informations clés pour l'investisseur, les rapports annuel et semestriel du Fonds pour la Suisse peuvent être obtenus gratuitement auprès du Représentant en Suisse.