

CARACTERISTIQUES (Source : Groupe Amundi)

Date création : 26/06/2020

Forme juridique : SICAV de droit luxembourgeois

Directive : UCITS IV

Classification AMF :

Obligations & titres de créance internationales

Indice Référence :

100% MARKIT - (1/3 ITRAXX EUROPE CROSSOVER AND 2/3 CDX.NA.HY USD HEDGED) 1.5X LEVERAGED FUNDED EURO INDEX

Eligible au PEA : Non

Devise : EUR

Affectation des sommes distribuables :

Capitalisation

Code ISIN : LU2036818529

Code Bloomberg : -

Durée minimum de placement recommandé : au moins 3 ans

Echelle de risque (selon DICI) :



CHIFFRES CLES (Source : Groupe Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : 93,88 (EUR)

Actif géré : 187,22 (millions EUR)

Derniers coupons versés : -

ACTEURS (Source : Groupe Amundi)

Société de gestion : CPR ASSET MANAGEMENT

Dépositaire / Valorisateur :

CACEIS Bank, Luxembourg Branch / CACEIS Bank, Luxembourg Branch

MODALITES DE FONCTIONNEMENT (Source : Groupe Amundi)

Fréquence de valorisation : Quotidienne

Heure limite d'ordre : 14:00

VL d'exécution : J

Date de valeur souscription / Date de valeur rachat : J+2 / J+2

Minimum 1ère souscription :

1 dix-millième part(s)/action(s)

Minimum souscription suivante :

1 dix-millième part(s)/action(s)

Frais d'entrée (max) / Frais de sortie (max) :

3,00% / 0,00%

Frais de gestion annuels (max) : 0,50%

Frais administratifs annuels (max) : 0,10%

Commission de surperformance : Non

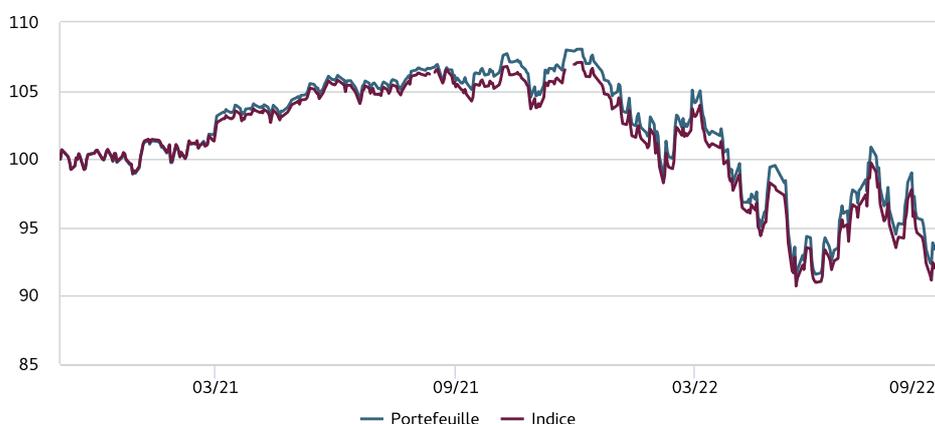
Tous les détails sont disponibles dans la documentation juridique

STRATEGIE D'INVESTISSEMENT (Source : Groupe Amundi)

Le fonds offre aux investisseurs un accès aux marchés des émetteurs privés européens et américains de catégorie High Yield (risque de défaut plus élevé), via une exposition directe aux spreads de crédit. Son objectif est de surperformer son indice de référence sur la durée de placement recommandée (supérieure à 3 ans). Il investit via des swaps sur les séries les plus récentes des indices dérivés de crédit - Itraxx Crossover pour l'Europe et CDX.NA.HY pour les Etats-Unis - de maturité 5 ans.

ANALYSE DE LA PERFORMANCE (Source : Fund Admin)

EVOLUTION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE EN BASE 100 (Source : Fund Admin)



PERFORMANCES NETTES PAR PERIODE GLISSANTE (Source : Fund Admin) ¹

	Depuis le	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans	Depuis le
	31/12/2021	31/08/2022	30/06/2022	30/09/2021	-	-	03/12/2020
Portefeuille	-13,30%	-0,89%	2,13%	-11,41%	-	-	-3,52%
Indice	-13,80%	-1,33%	1,30%	-12,35%	-	-	-4,31%
Ecart	0,51%	0,44%	0,83%	0,94%	-	-	0,79%

¹ Les données supérieures à un an sont annualisées.

PERFORMANCES NETTES PAR ANNÉE CIVILE (Source : Fund Admin) ²

	2021	2020	2019	2018	2017
Portefeuille	7,34%	-	-	-	-
Indice	6,35%	-	-	-	-
Ecart	0,98%	-	-	-	-

² Les performances passées ne sont pas constantes dans le temps et ne sont pas un indicateur fiable des performances futures. Les investissements sont soumis aux fluctuations de marché et peuvent varier à la hausse comme à la baisse.

ANALYSE DU RISQUE (Source : Fund Admin)

	1 an	3 ans	5 ans	Depuis le lancement
Volatilité du portefeuille	11,60%	-	-	9,22%
Volatilité de l'indice	10,76%	-	-	8,64%
Tracking Error ex-post	1,40%	-	-	1,11%
Ratio d'information	0,67	-	-	0,71
Ratio de Sharpe du portefeuille	-0,97	-	-	-0,35

Données annualisées

Equipe de gestion



Julien Daire

Responsable Gestion Monétaires Taux



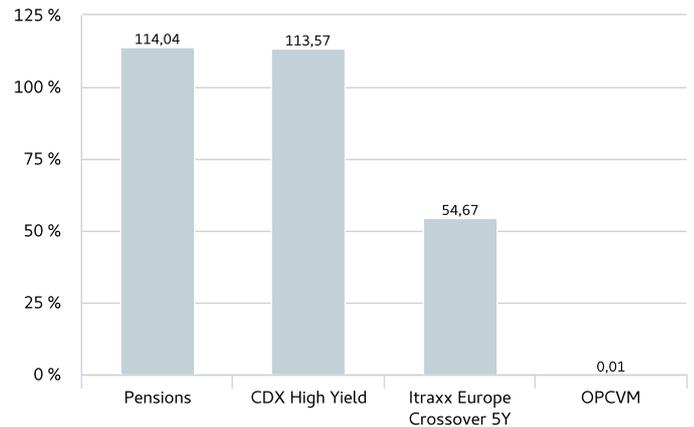
Zakaria Darouich

Gérant de portefeuille

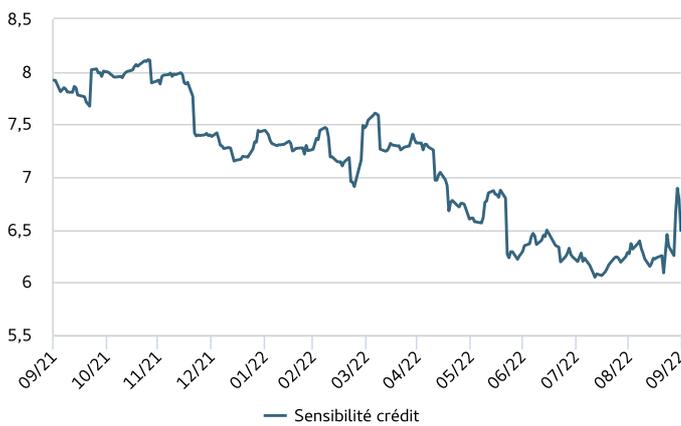
ANALYSE GLOBALE (Source : Groupe Amundi)

	Portefeuille
Sensibilité Crédit	6,49
Exposition Crédit	168,40%
Sensibilité Taux	0,00
Note Moy. Agence LT	BBB
Liquidités Inf. 7 jours	107,74%
Taux actuariel brut	10,49%

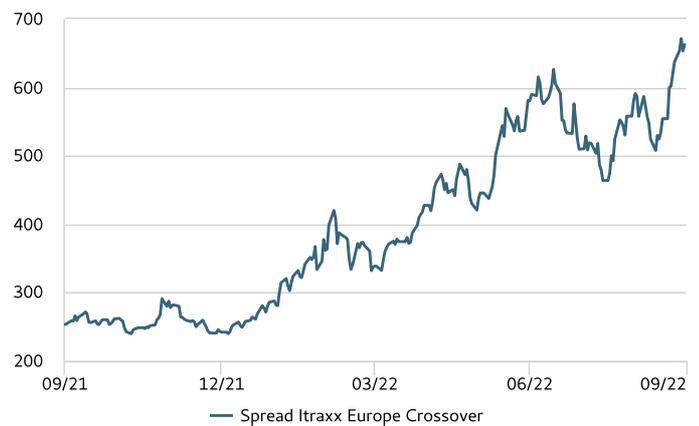
EXPOSITION PAR TYPES D'INSTRUMENTS (Source : Groupe Amundi)



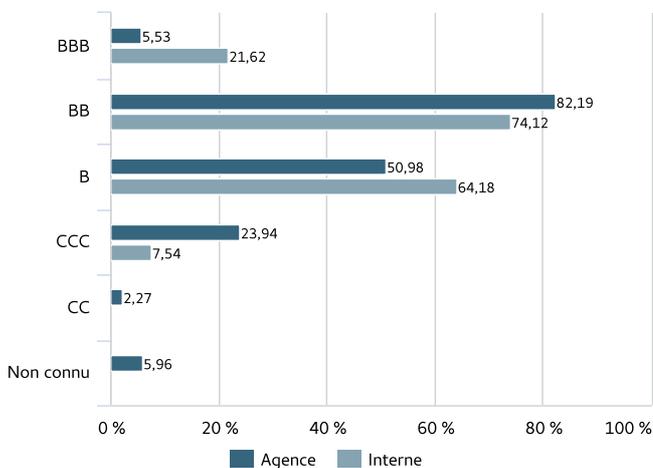
EVOLUTION DE LA SENSIBILITE CREDIT (Source : Groupe Amundi)



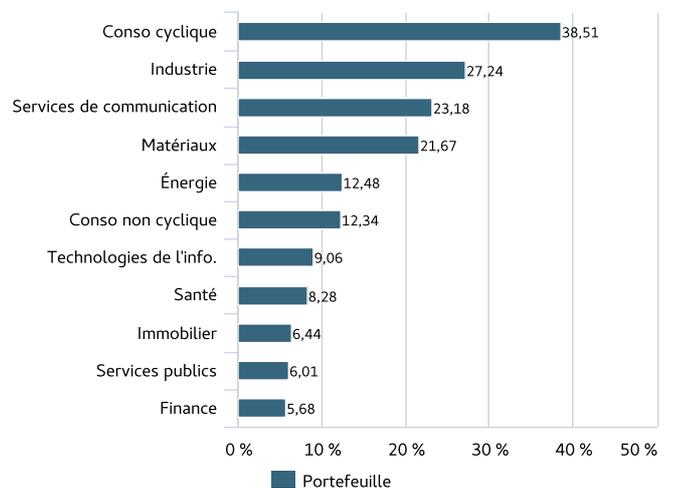
EVOLUTION DU SPREAD DE CREDIT SUR 1 AN (Source : Groupe Amundi)



EXPOSITION PAR NOTATION DES EMETTEURS (Source : Groupe Amundi)



EXPOSITION PAR SECTEUR (Source : Groupe Amundi)



* Sur Dérivés de Crédit