

# AMUNDI OBLIGATAIRE DIVERSIFIE ESR - PER CA

REPORTING

Communication  
Publicitaire

30/11/2022

OBLIGATAIRE ■

Article 8 ■

## Données clés (Source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : **143,45 ( EUR )**  
Date de VL et d'actif géré : **30/11/2022**  
Actif géré : **319,70 ( millions EUR )**  
Indice de référence :  
**100% BLOOMBERG EURO AGGREGATE (E)**

## Objectif d'investissement

Ce FCPE multi-entreprises est investi en supports obligataires publics ou privés libellés en euro. Il vise à valoriser à moyen terme le capital investi par la mise en œuvre d'une gestion active de la sensibilité du portefeuille, de son positionnement sur la courbe des taux et de sa diversification sur le crédit. Cet investissement est soumis aux risques de fluctuation des marchés concernés.

## Profil de risque et de rendement (SRII) (Source : Fund Admin)



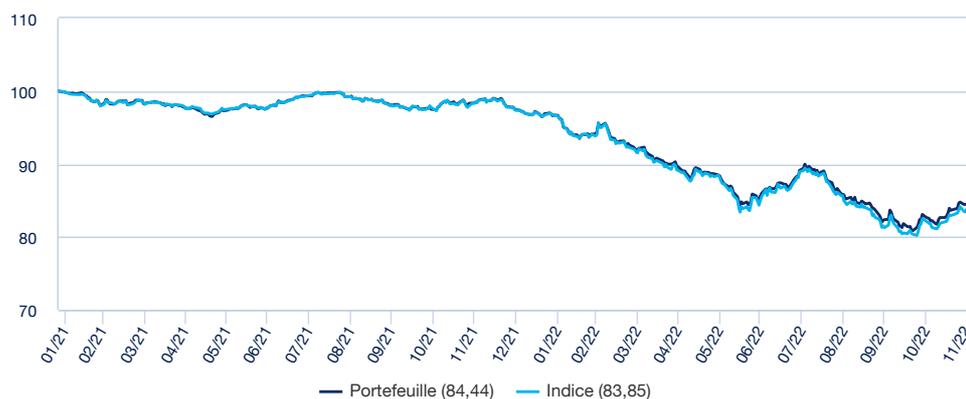
⚡ A risque plus faible, rendement potentiellement plus faible

⚡ A risque plus élevé, rendement potentiellement plus élevé

Le SRII correspond au profil de risque et de rendement présent dans le Document d'Information Clé pour l'Investisseur (DICI). La catégorie la plus faible ne signifie pas « sans risque ». Il n'est pas garanti et pourra évoluer dans le temps.

## Performances (Source : Fund Admin) - Les performances passées ne préjugent pas des performances futures

### Evolution de la performance (base 100) \* (Source : Fund Admin)



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

	1 an	3 ans	5 ans
Volatilité du portefeuille	7,39%	-	-
Volatilité de l'indice	8,06%	-	-
Tracking Error ex-post	2,31%	-	-
Ratio d'information	0,14	-	-
Ratio de Sharpe	-1,84	-	-

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	-19,14%
Moins bon mois	09/2022
Moins bonne performance	-3,93%
Meilleur mois	07/2022
Meilleure performance	4,11%

### Performances glissantes \* (Source : Fund Admin)

Depuis le	Depuis le	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans
	31/12/2021	31/10/2022	31/08/2022	30/11/2021	-	-
<b>Portefeuille</b>	-13,33%	2,15%	-1,52%	-14,21%	-	-
<b>Indice</b>	-13,86%	2,08%	-1,25%	-14,69%	-	-
<b>Ecart</b>	0,53%	0,07%	-0,27%	0,47%	-	-

### Performances calendaires \* (Source : Fund Admin)

	2021	2020	2019	2018	2017
<b>Portefeuille</b>	-	-	-	-	-
<b>Indice</b>	-	-	-	-	-
<b>Ecart</b>	-	-	-	-	-

### Indicateurs (Source : Amundi)

	Portefeuille	Indice
<b>Sensibilité</b>	6,54	6,56
<b>Nombre de lignes</b>	69	7179

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.

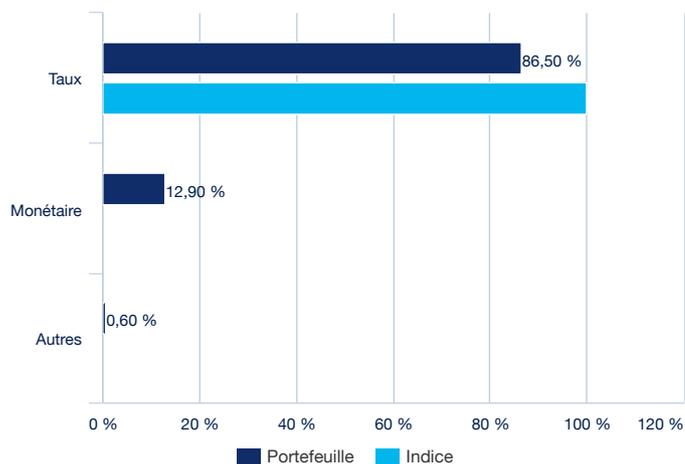
OBLIGATAIRE ■

Commentaire de gestion

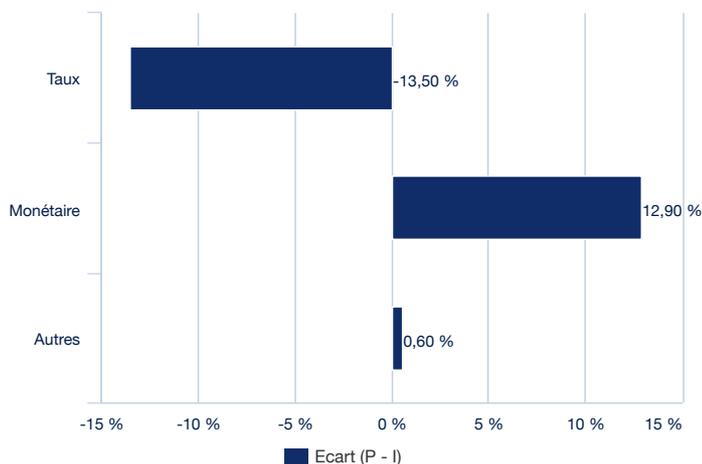
Report Ok

Composition du portefeuille (Source : Amundi)

Allocation d'actifs (Source : Amundi)

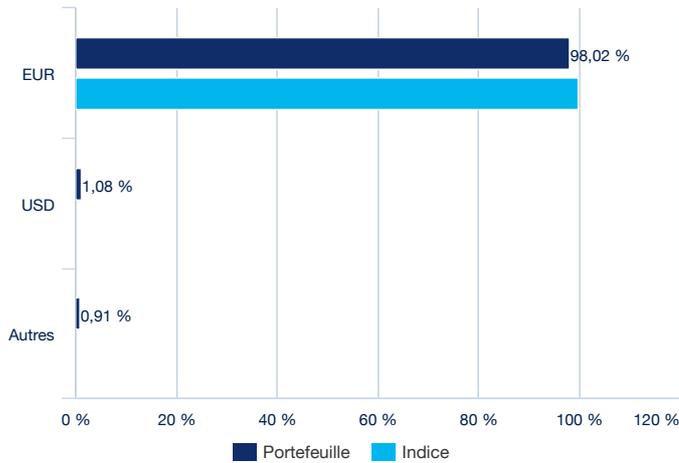


Allocation d'actifs en relatif (Source : Amundi)



OBLIGATAIRE ■

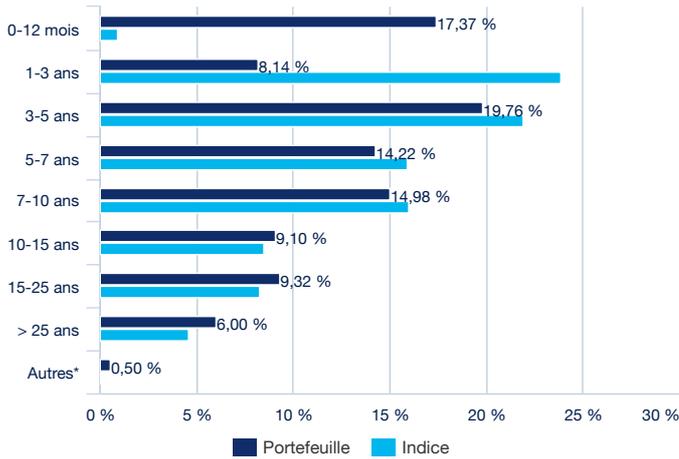
Répartition par devises (Source : Amundi)



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

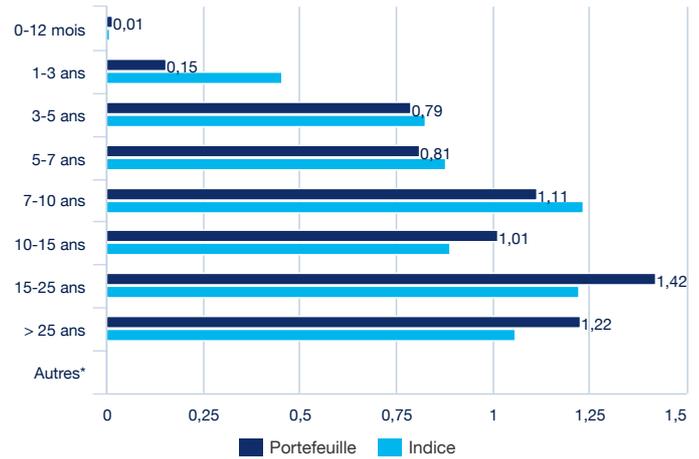
Répartition par maturités (Source : Amundi)

En % d'actif



Répartition par maturités (Source : Amundi)

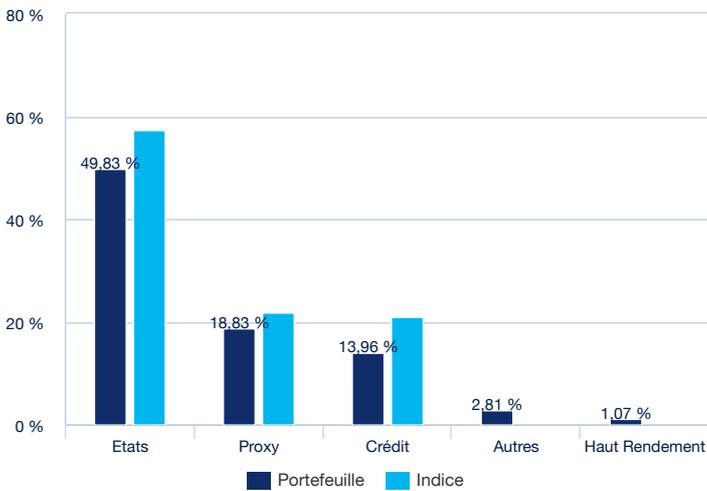
En points de sensibilité



\* Autres : non classés, dépôts, appels de marge ...

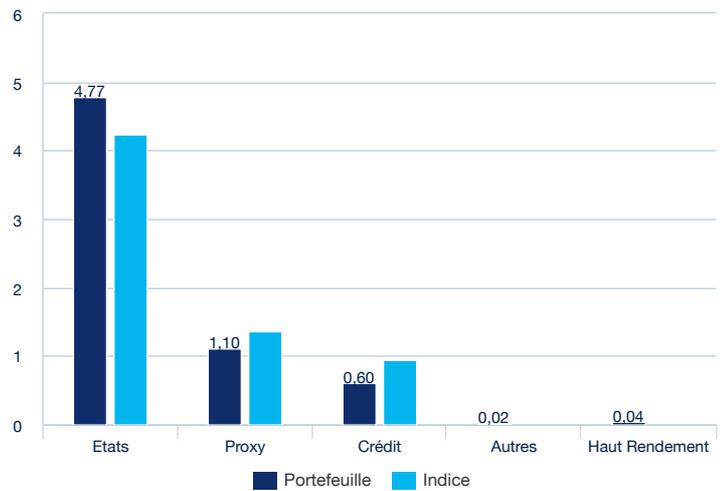
Répartition par types émetteurs (Source : Amundi)

En % d'actif



Répartition par types émetteurs (Source : Amundi)

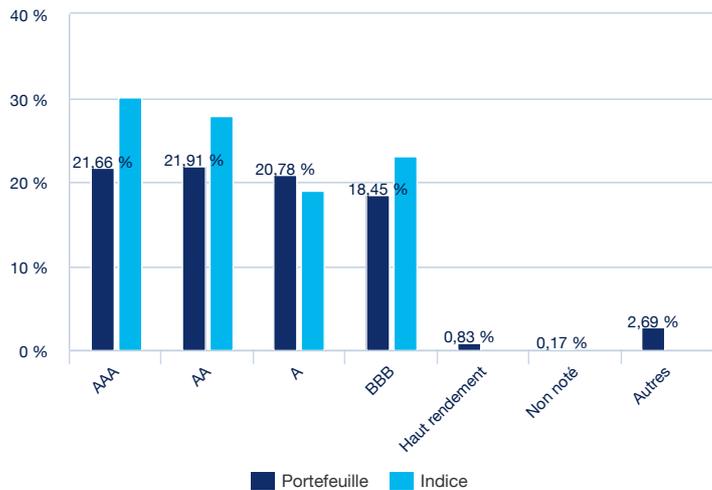
En points de sensibilité



OBLIGATAIRE

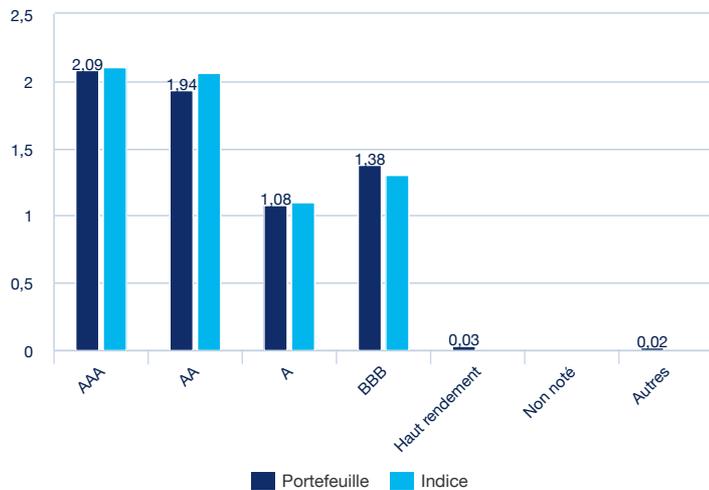
Répartition par notations (Source : Amundi)

En % d'actif



Répartition par notations (Source : Amundi)

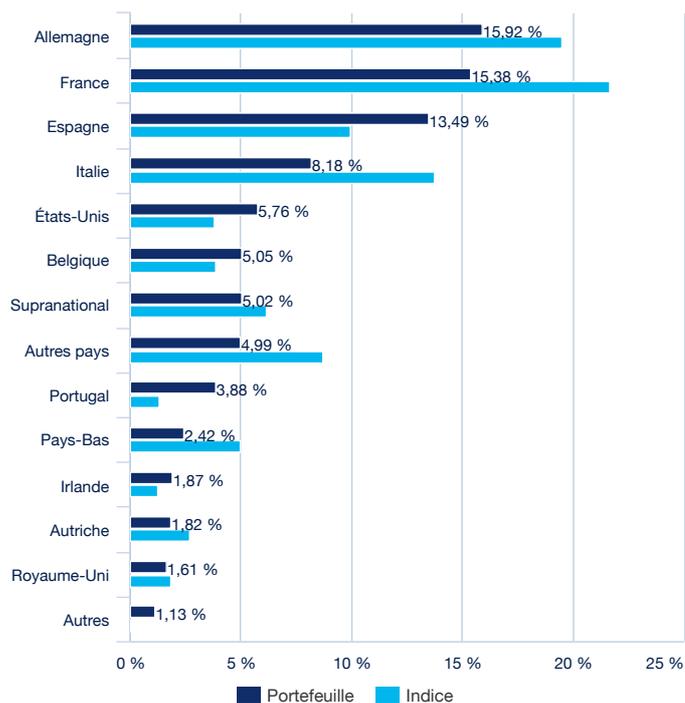
En points de sensibilité



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

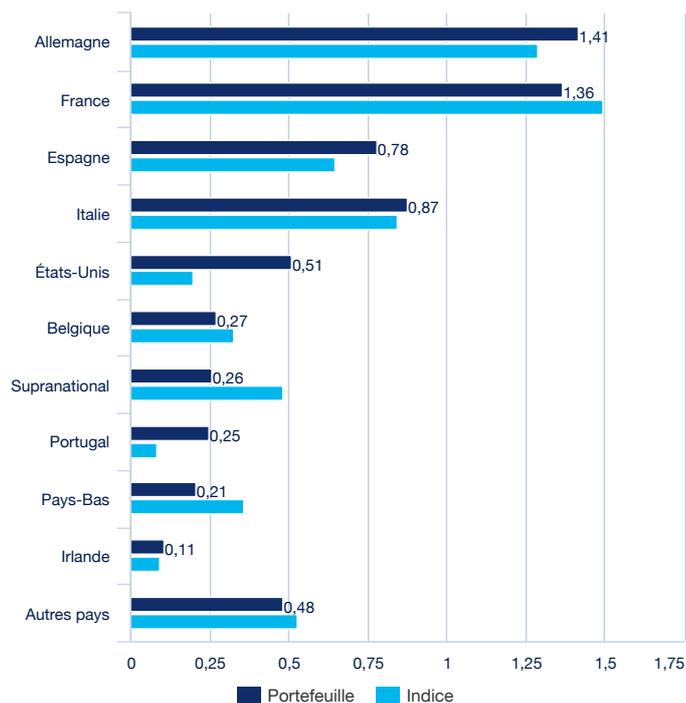
Répartition par pays (Source : Amundi)

En % d'actif



Répartition par pays (Source : Amundi)

En points de sensibilité



## OBLIGATAIRE ■

**Principaux émetteurs obligations (Source : Amundi)**

	<b>% d'actif</b>
SPAIN (KINGDOM OF )	12,33%
FRANCE	7,12%
ITALIAN REPUBLIC	6,25%
GERMANY	5,71%
BELGIUM	4,74%
EUROPEAN INVESTMENT BANK	4,18%
KFW-KDT F WDERAUFBAU	3,94%
PORTUGAL	3,81%
AGENCE FRSE DEVELOPMENT	3,37%
KFW-KDT F WDERAUFBAU-STATE GTY	2,45%
<b>Total</b>	<b>53,90%</b>

## OBLIGATAIRE ■

## Caractéristiques principales (Source : Amundi)

Forme Juridique	FCPE
Droit applicable	de droit français
Société de gestion	Amundi Asset Management
Dépositaire	CACEIS Bank
Date de création de la classe	11/01/2021
Devise de référence de la classe	EUR
Affectation des sommes distribuables	Capitalisation
Périodicité de calcul de la VL	Quotidienne
Commission de surperformance	Non
Frais courants	0,97% ( prélevés ) - 31/12/2021
Durée minimum d'investissement recommandée	3 ans
Classification AMF	FCPE Oblig. & créances Euro
Code AMF	990000127069
Nom du fonds maître	AMUNDI RESA OBLIG DIVERSIFIE

## Avertissement

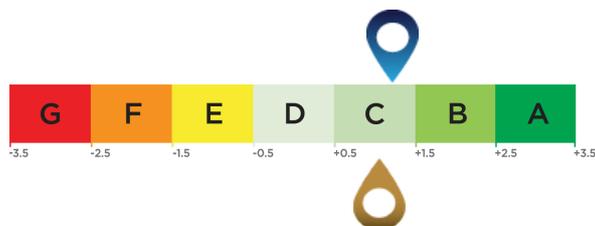
Document simplifié et non contractuel, destiné à être remis exclusivement aux porteurs de parts. Les caractéristiques principales du fonds sont mentionnées dans sa documentation juridique sur simple demande au siège social de la société de gestion. La documentation juridique vous est remise avant toute souscription à un fonds. Ce fonds est géré par Amundi Asset Management. Investir implique des risques : les valeurs des parts ou actions des Fonds d'Épargne Salariale 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 Fonds d'Épargne Salariale peuvent perdre tout ou partie de leur capital initialement investi. Il appartient à toute personne intéressée par les Fonds d'Épargne Salariale préalablement à toute souscription de prendre connaissance des documents réglementaires en vigueur. La source des données du présent document est Amundi sauf mention contraire. La date des données du présent document est celle indiquée sous la mention SYNTHÈSE DE GESTION en tête du document sauf mention contraire.

## OBLIGATAIRE ■

## Note ESG moyenne (source : Amundi)

Notation environnementale, sociale et de gouvernance

## Univers d'investissement ESG: 100% BLOOMBERG EURO AGGREGATE (E)



Score du portefeuille d'investissement: 1,26

Score de l'univers d'investissement ESG<sup>1</sup>: 1,09

## Couverture ESG (source : Amundi)

	Portefeuille	Univers d'investissement ESG
Pourcentage avec une notation ESG Amundi <sup>2</sup>	98,46%	99,10%
Pourcentage pouvant bénéficier d'une notation ESG <sup>3</sup>	98,59%	99,94%

## 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'Amundi<sup>4</sup>, 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.

<sup>1</sup> 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.

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

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

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