

GROUPAMA JAPON STOCK ID

Compartiment de SICAV de droit français

Août 2024

Données au 30/08/2024

Objectif de gestion

L'objectif de gestion est de chercher à obtenir une performance régulièrement en ligne avec celle de son indicateur de référence, le MSCI Japan net en Euros (mais non couvert du risque de change du yen par rapport à l'Euro) (clôture - dividendes nets réinvestis), sur la durée de placement recommandée, supérieure à 5 ans. Pour cela, le gérant pourra intervenir, par le biais d'une gestion sous contrainte de tracking error (TE) ex-ante limitée à 1%, principalement sur des actions japonaises.

Actif net global

79,18 M €

Valeur liquidative

1 618,6 €

Profil de risque

Risque plus faible

1 2 3 4 5 6 7

Risque plus élevé

Rendement potentiellement plus faible

Cet indicateur représente le profil de risque affiché dans le DIC. La catégorie de risque n'est pas garantie et peut changer au cours du mois.

Rendement potentiellement plus élevé

Durée de placement recommandée

2 ans 3 ans 5 ans 7 ans

Caractéristiques

Code Bloomberg	NPPNGAN FP
Indicateur de référence	MSCI Japan clôture net €
Classification SFDR	Article 6
Date de création du fonds	01/09/1986
Date de création de la part	01/09/1986
Devise de valorisation	EUR
PEA	Non
PEA-PME	Non

Frais

Commission de souscription maximum	2,75%
Commission de rachat maximum	-
Frais de gestion directs maximum	0,80%
Frais de gestion indirects maximum	0,00%

Notation Morningstar

(Données au 31/07/2024)



Catégorie " EAA Fund Japan Large-Cap Equity"

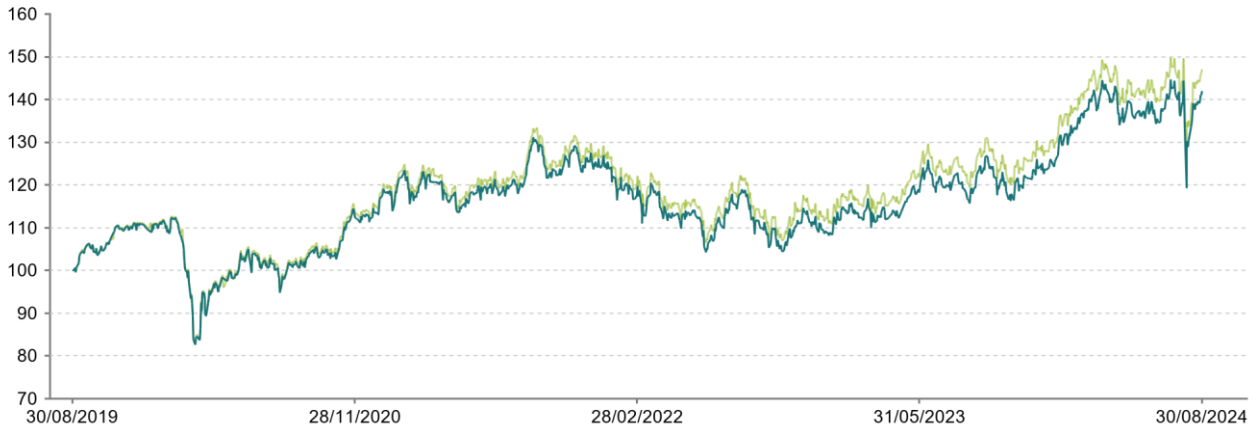
Conditions de commercialisation

Fréquence de valorisation	Quotidienne
Type de part	Distribution
Minimum de première souscription :	-
Heure limite de centralisation	11:00, heure de Paris
Type de valeur liquidative	Du lendemain
Règlement	J+3
Dépositaire / Conservateur	CACEIS BANK

GROUPAMA JAPON STOCK ID

MSCI JAPAN CLÔTURE NET €

PERFORMANCE DU PORTEFEUILLE



Les performances passées ne préjugent pas des performances futures.

Source : Groupama AM

Performances cumulées nettes en %

	YTD	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans	10 ans
Depuis le	29/12/23	31/07/24	31/05/24	31/08/23	31/08/21	30/08/19	29/08/14
OPC	12,72	-1,67	3,63	17,00	17,00	42,00	104,94
Indicateur de référence	12,77	-1,74	3,54	17,36	19,27	47,03	120,49
Écart	-0,06	0,07	0,09	-0,36	-2,27	-5,03	-15,56

Performances annuelles nettes en %

	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
OPC	15,28	-11,87	9,13	3,76	21,58	-9,88	8,03	5,31	20,35	13,30
Indicateur de référence	16,24	-11,18	10,01	4,57	22,51	-9,09	8,91	6,17	21,32	9,58
Écart	-0,96	-0,69	-0,88	-0,81	-0,94	-0,79	-0,87	-0,86	-0,97	3,71

Source : Groupama AM

Analyse du risque

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans
Volatilité	17,27%	15,53%	17,66%	18,19%
Volatilité de l'indice de référence	17,22%	15,51%	17,65%	18,17%
Tracking Error (Ex-post)	0,30	0,18	0,15	0,16
Ratio d'information	-1,17	-3,66	-4,85	-4,81
Ratio de Sharpe	0,65	0,17	0,34	0,59
Coefficient de corrélation	1,00	1,00	1,00	1,00
Beta	1,00	1,00	1,00	1,00

Source : Groupama AM

Principaux risques

- Risque actions
- Risque de perte en capital
- Risque de change

Profil de l'OPC

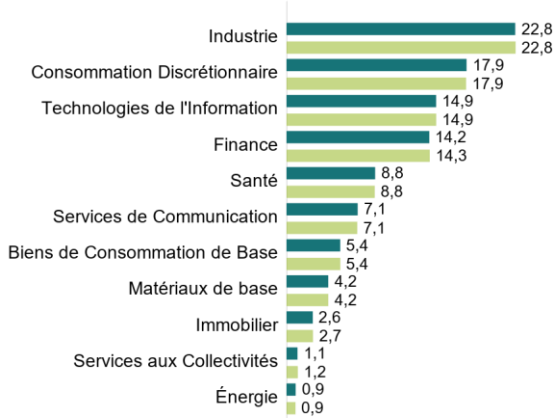
Nombre de lignes	197
Capitalisation moyenne	19,71 Mds €
Capitalisation médiane	8,85 Mds €



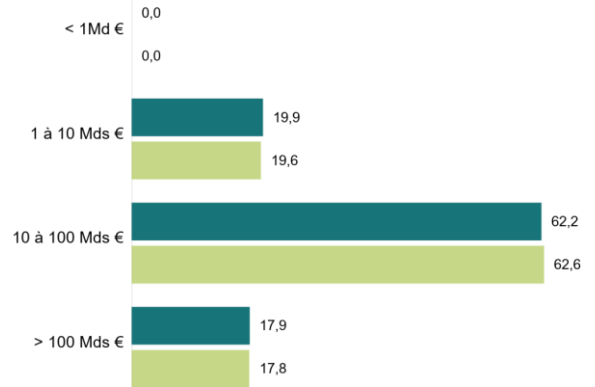
GROUPAMA JAPON STOCK ID

MSCI JAPAN CLÔTURE NET €

Répartition sectorielle (en % d'actif, hors liquidité)



Répartition par taille de capitalisation (en % d'actif, hors liquidité)



Répartition géographique (en % d'actif, hors liquidité)



Répartition par devise (en % d'actif, hors liquidité)



Dix principales lignes actions en portefeuille

	Pays	Secteur	% de l'actif
TOYOTA MOTOR CORP	Japon	Consommation Discrétionnaire	4,91%
SONY GROUP CORP	Japon	Consommation Discrétionnaire	3,08%
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GRO	Japon	Finance	2,93%
HITACHI LTD	Japon	Industrie	2,91%
RECRUIT HOLDINGS CO LTD	Japon	Industrie	2,34%
KEYENCE CORP	Japon	Technologies de l'Information	2,33%
SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GR	Japon	Finance	2,06%
SHIN-ETSU CHEMICAL CO LTD	Japon	Matériaux de base	2,02%
TOKYO ELECTRON LTD	Japon	Technologies de l'Information	2,01%
DAIICHI SANKYO CO LTD	Japon	Santé	1,97%
Total			26,55%

Équipe de gestion

Source : Groupama AM

Source de données

© 2024 Morningstar. Tous droits réservés. Les informations, données, analyses, et opinions contenues ici (1) comprennent des informations exclusives de Morningstar, (2) ne peuvent être copiées ni redistribuées, (3) ne constituent pas des conseils en matière d'investissements offerts par Morningstar, (4) sont fournies uniquement à titre d'information et, de ce fait, ne constituent pas une offre d'achat ou de vente d'un titre, et (5) ne sont pas garanties comme correctes, complètes, ou précises. Morningstar ne sera pas tenu responsable des décisions commerciales, des dommages ou autres pertes causés ou liés à ces informations, à ces renseignements, à ces analyses ou à ces opinions ou à leur usage

Historique des modifications de l'indicateur de référence (10 ans)

Néant

Avertissement

Groupama Asset Management décline toute responsabilité en cas d'altération, déformation ou falsification dont ce document pourrait faire l'objet. Toute modification, utilisation ou diffusion non autorisée, en tout ou partie de quelque manière que ce soit est interdite.

Les performances passées ne préjugent pas des performances futures, et ne sont pas constantes dans le temps.

Les informations relatives à la durabilité sont accessibles sur <https://www.groupama-am.com/fr/finance-durable/>.

Les informations contenues dans cette publication sont basées sur des sources que nous considérons fiables, mais nous ne garantissons pas qu'elles soient exactes, complètes, valides ou à propos. Ce Document peut être modifié à tout moment sans avis préalable.

Ce support non contractuel ne constitue en aucun cas une recommandation, une sollicitation d'offre, ou une offre d'achat, de vente ou d'arbitrage, et ne doit en aucun cas être interprété comme tel.

L'investissement présente un risque de perte en capital. Tout investisseur doit prendre connaissance avant tout investissement du prospectus ou du document d'information clé (DIC) de l'OPC. Ces documents et les autres documents périodiques peuvent être obtenus gratuitement sur simple demande auprès de Groupama AM ou sur www.groupama-am.com.

Société d'investissement à capital variable (SICAV) de droit Français ayant la forme d'une Société Anonyme – domiciliée au 25 rue de la Ville l'Evêque – 75008 Paris et agréée par l'Autorité des marchés financiers (AMF).

L'investisseur est averti que tous les compartiments de la SICAV ne sont pas nécessairement enregistrés ou autorisés à la commercialisation ou accessibles à tous, dans toutes les juridictions. La Société de Gestion peut à tout moment décider de mettre fin à la commercialisation du Compartiment dans une ou plusieurs juridictions à tout moment.

L'accès aux produits et services présentés peut faire l'objet de restrictions à l'égard de certaines personnes ou de certains pays. Le traitement fiscal dépend de la situation de chacun.

Espagne : Le Prospectus ainsi que le Document d'information pour l'investisseur disponible en espagnol et les rapports annuel et semestriel peuvent être obtenus auprès de Groupama Asset Management SA sucursal en España, Paseo de la Castellana 95 28 Torre Europa, Madrid, inscrit sous le numéro 5 du registre SGIIC de la CNMV ou sur www.groupama-am.com/es.

Italie : le Prospectus ainsi que le Document d'information pour l'investisseur disponible en italien et les rapports annuel et semestriel peuvent être obtenus auprès de Groupama AM succursale italiana, Via di Santa Teresa 35, Roma ou sur le site www.groupama-am.fr/it.