



Reporting mensuel au 31/08/2022

Indicateur de référence : Bloomberg Global Aggregate (couvert en €)

CHIFFRES CLES

| | |
|-------------------------------------|-------------|
| Actif net toutes parts confondues : | 409,09 M € |
| Actif net de la part : | 409,09 M € |
| VL au 31/08/22 : | 92,4 |
| Devise de valorisation : | EUR |
| Fréquence de valorisation : | Quotidienne |

INFORMATIONS SUR LE FONDS

Caractéristiques

| | |
|-----------------------|--|
| Classification AMF : | Obligations et autres titres de créance internationaux |
| Catégorie | Obligations internationales |
| Europerformance : | |
| Type d'OPC : | FIA |
| Date d'agrément AMF : | 15/09/2015 |
| Code Bloomberg : | GROHOMN FP |

Durée de placement recommandée

Supérieure à 3 ans

Conditions de commercialisation

| | |
|---------------------------------------|--|
| Minimum de première souscription : | - |
| Souscription suivante : | En millième(s) de part |
| Dépositaire / Conservateur : | CACEIS BANK |
| Conditions de souscription / rachat : | Tous les jours jusqu'à 12:00 - VL Inconnue - Règlement J+3 |

Frais

| | |
|--|-------|
| Commission de souscription maximum : | 2,75% |
| Commission de rachat maximum : | - |
| Frais de gestion directs (maximum) : | 1,00% |
| Frais de gestion indirects (maximum) : | 0,80% |

Le détail des frais supportés par l'OPC est consultable dans le Prospectus.

FOURCHETTE DE SENSIBILITE

| | |
|---------|---------|
| Minimum | Maximum |
| 0,0 | 10,0 |

EVOLUTION DE LA PERFORMANCE *

GROUPAMA HORIZON OBLIGATIONS MONDE N Indicateur de référence

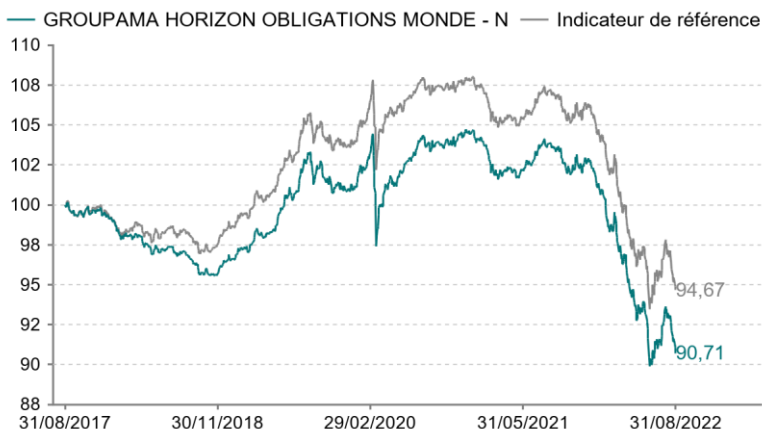
Performances annuelles nettes en % (5 ans)

| Année | 2021 | 2020 | 2019 | 2018 | 2017 |
|-------------------------|-------|-------|-------|-------|-------|
| OPC | -2,37 | 3,80 | 4,37 | -2,89 | 0,55 |
| Indicateur de référence | -2,23 | 4,24 | 5,10 | -1,04 | 1,06 |
| Ecart | -0,14 | -0,44 | -0,73 | -1,85 | -0,51 |

Performances cumulées nettes en %

| Période | 1 mois | 3 mois | YTD | 1 an | 3 ans | 5 ans |
|-------------------------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|
| | 29/07/22 | 31/05/22 | 31/12/21 | 31/08/21 | 30/08/19 | 31/08/17 |
| OPC | -2,84 | -2,98 | -11,20 | -12,40 | -12,06 | -9,29 |
| Indicateur de référence | -2,87 | -2,25 | -10,34 | -11,43 | -10,33 | -5,33 |
| Ecart | 0,03 | -0,73 | -0,85 | -0,97 | -1,72 | -3,96 |

Performances 5 ans (base 100)



* Les performances passées ne préjugent pas des résultats futurs. Elles ne tiennent pas compte d'éventuelles commissions perçues lors de la souscription et du rachat de parts.

ANALYSE DU RISQUE (sur 1 an)

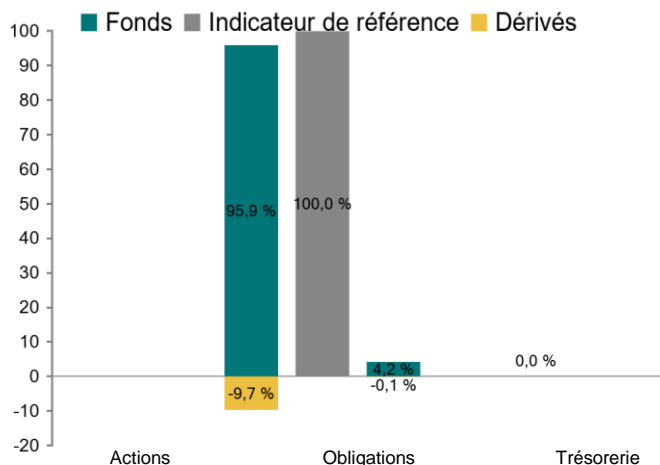
| | OPC | Indicateur de référence |
|--------------------------|-------|-------------------------|
| Volatilité | 4,92 | 4,75 |
| Ratio de Sharpe | -2,60 | -2,46 |
| Tracking Error (Ex-post) | 0,88 | - |
| Ratio d'information | -1,08 | - |
| Beta | 1,02 | - |

ANALYSE DU PORTEFEUILLE AU 31/08/2022

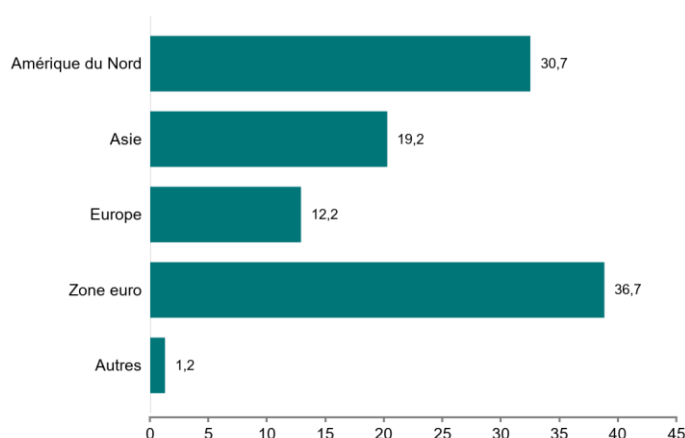
GROUPAMA HORIZON OBLIGATIONS MONDE N

■ Indicateur de référence

ALLOCATION PAR CLASSE D'ACTIFS (en % d'exposition)



REPARTITION GEOGRAPHIQUE (en % de l'actif hors liquidités)



PERFORMANCES DES PRINCIPAUX FONDS INTERNES

| Fonds | % de l'actif | Performance fonds YTD | Performance bench YTD | Ecart | Performance fonds MTD | Performance bench MTD | Ecart |
|---|--------------|-----------------------|-----------------------|--------|-----------------------|-----------------------|-------|
| G FUND - GLOBAL BONDS - IC | 34,20% | -10,91% | -10,34% | -0,57% | -2,51% | -2,87% | 0,36% |
| GROUPAMA ETAT MONDE - I | 24,75% | -9,30% | -9,52% | 0,22% | -2,56% | -2,73% | 0,18% |
| GROUPAMA ETAT EURO ISR - ID | 4,01% | -13,36% | -13,37% | 0,02% | -5,12% | -5,19% | 0,07% |
| G FUND - GLOBAL INFLATION SHORT DURATION - IC | 2,07% | -0,06% | -0,78% | 0,72% | -0,99% | -1,52% | 0,53% |
| GROUPAMA CREDIT EURO - IC | 1,93% | -12,32% | -11,64% | -0,67% | -3,85% | -4,23% | 0,38% |

HISTORIQUE DES PERFORMANCES * EN % (5 ANS)

| Année | Fonds | Janvier | Février | Mars | Avril | Mai | Juin | Juillet | Août | Septembre | Octobre | Novembre | Décembre | Année |
|-------|-------------------------|---------|---------|-------|-------|-------|-------|---------|-------|-----------|---------|----------|----------|--------|
| 2022 | OPC | -1,72 | -1,71 | -1,77 | -3,14 | -0,41 | -2,78 | 2,71 | -2,84 | | | | | -11,20 |
| | Indicateur de référence | -1,66 | -1,38 | -2,31 | -2,93 | -0,26 | -1,72 | 2,40 | -2,87 | | | | | -10,34 |
| 2021 | OPC | -0,65 | -1,65 | -0,42 | 0,22 | 0,16 | 0,50 | 1,14 | -0,31 | -0,99 | -0,37 | 0,44 | -0,44 | -2,37 |
| | Indicateur de référence | -0,61 | -1,62 | -0,49 | 0,19 | 0,16 | 0,44 | 1,18 | -0,26 | -1,02 | -0,32 | 0,67 | -0,54 | -2,23 |
| 2020 | OPC | 1,65 | 0,70 | -3,24 | 2,00 | 0,32 | 0,69 | 1,27 | -0,73 | 0,29 | 0,00 | 0,77 | 0,11 | 3,80 |
| | Indicateur de référence | 1,64 | 1,06 | -1,75 | 1,50 | 0,22 | 0,43 | 0,97 | -0,78 | 0,31 | -0,06 | 0,49 | 0,18 | 4,24 |
| 2019 | OPC | 0,71 | -0,14 | 1,31 | -0,15 | 1,07 | 1,24 | 0,46 | 2,13 | -0,84 | -0,48 | -0,47 | -0,50 | 4,37 |
| | Indicateur de référence | 0,79 | -0,12 | 1,55 | -0,19 | 1,18 | 1,11 | 0,55 | 2,04 | -0,71 | -0,41 | -0,31 | -0,45 | 5,10 |
| 2018 | OPC | -0,77 | -0,59 | 0,11 | -0,64 | -0,20 | -0,18 | -0,21 | -0,17 | -0,56 | -0,58 | -0,10 | 0,98 | -2,89 |
| | Indicateur de référence | -0,87 | -0,41 | 0,58 | -0,60 | 0,15 | -0,06 | -0,20 | 0,07 | -0,61 | -0,45 | 0,25 | 1,12 | -1,04 |

* Les performances passées ne préjugent pas des résultats futurs. Elles ne tiennent pas compte d'éventuelles commissions perçues lors de la souscription et du rachat de parts.

HISTORIQUE DES MODIFICATIONS DE L'INDICATEUR DE RÉFÉRENCE (5 ANS)

| | |
|-------------------------|--|
| 01/09/2002 - 07/03/2018 | Barclays Capital Global Aggregate (couvert en €) |
| 07/03/2018 - 24/08/2021 | BarCap Global Aggregate (couvert en €) |
| 24/08/2021 | Bloomberg Global Aggregate (couvert en €) |

Toutes les données nous provenant de l'extérieur sont retravaillées par Groupama Asset Management.

Les informations contenues dans ce document sont uniquement transmises à titre d'information. Les équipes commerciales de Groupama Asset Management et ses filiales sont à votre disposition afin de vous permettre d'obtenir une recommandation personnalisée. Toute utilisation ou diffusion non autorisée, en tout ou partie et de quelque manière que ce soit, est interdite. Groupama Asset Management et ses filiales déclinent toute responsabilité en cas d'altération, déformation ou falsification dont ce document pourrait faire l'objet. 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 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. Tout investisseur doit prendre connaissance avant tout investissement du prospectus/règlement ou document d'information clé de l'investisseur (DIC) du fonds. Ces documents et le dernier document périodique sont disponibles auprès de Groupama Asset Management sur simple demande.