

GROUPAMA ABSOLUTE RETURN NC

Fonds nourricier de GROUPAMA ALPHA FIXED INCOME PLUS

1 Anciennement GROUPAMA SELECTION PROTECT 85 N. Date d'effet du changement de dénomination : 24/06/2024.

Août 2024Données au **30/08/2024****Objectif de gestion**

Le même objectif que celui de son maître : chercher à obtenir une performance supérieure à celle de son indicateur de référence, l'ESTER capitalisé, sur la durée de placement recommandée, supérieure à 18 mois en recherchant à avoir une volatilité historique à 52 semaines calculée en pas quotidiens inférieure à 5%. Pour cela, le gérant pourra intervenir, au moyen d'une gestion active et discrétionnaire, principalement par la mise en place de stratégies d'arbitrages sur des actifs obligataires et monétaires, qui répondent à des caractéristiques ESG (Environnementales, Sociales et de Gouvernance).

Actif net global

6,13 M €

Valeur liquidative

102,46 €

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**Caractéristiques**

Code Bloomberg	GPAP85N FP
Indicateur de référence	N/A
Classification SFDR	Article 8
Date de création du compartiment	11/06/2019
Date de création de la part	19/06/2019
Devise de valorisation	EUR
PEA	Non
PEA-PME	Non

Frais

Commission de souscription maximum	3,00%
Commission de rachat maximum	-
Frais de gestion directs maximum	1,20%
Frais de gestion indirects maximum	1,00%

SFDR 8**Conditions de commercialisation**

Fréquence de valorisation	Quotidienne
Type de part	Capitalisation
Minimum de première souscription :	-
Heure limite de centralisation	10:00, heure de Paris
Type de valeur liquidative	Inconnue
Règlement	J+2
Dépositaire / Conservateur	CACEIS BANK

GROUPAMA ABSOLUTE RETURN NC

Performance Absolue

Données au

30/08/2024

GROUPAMA ABSOLUTE RETURN NC

Performances 5 ans (base 100)



Les performances passées ne préjugent pas des performances futures.

Source : Groupama AM

+ La stratégie de gestion a fait l'objet d'une évolution au 06/08/2024, à cette date sont le reflet de cette précédente stratégie

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	-
OPC	2,89	-1,90	-0,14	5,02	0,41	1,86	-
Ecart	-	-	-	-	-	-	-

Performances annuelles nettes en %

	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
OPC	4,29	-8,10	7,40	-5,95	-	-	-	-	-	-
Indicateur de référence	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Ecart										

Source : Groupama AM

Analyse du risque

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans
Volatilité	3,01%	3,41%	4,44%	-
Tracking Error (Ex-post)	0,00	0,00	0,00	-
Ratio d'information	0,00	0,00	0,00	-
Ratio de Sharpe	0,37	-0,49	-0,15	-
Coefficient de corrélation	0,00	0,00	0,00	-
Beta	0,00	0,00	0,00	-

Source : Groupama AM

Principaux risques

Risque de taux

Risque de crédit

Risque de perte en capital

Risque actions

Risque lié à la mise en place d'une gestion prudente à titre transitoire

Risque lié à la gestion discrétionnaire

GROUPAMA ABSOLUTE RETURN NC

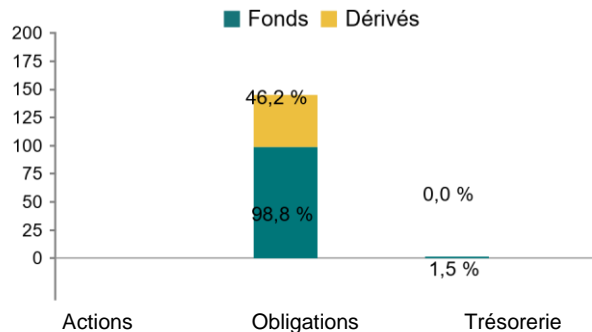
Structure du portefeuille

Valeur liquidative

Valeur liquidative Valeur liquidative garantie

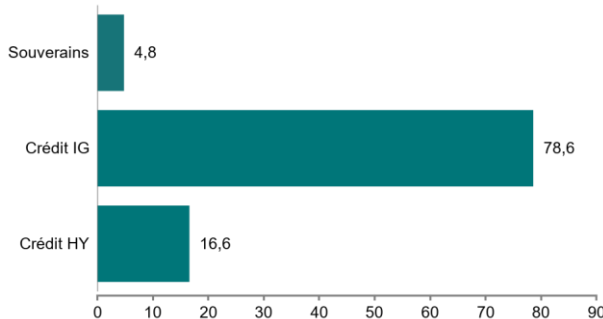
106,44	90,47
106,26	90,32
106,12	90,2
106,05	90,14
105,95	90,06

Répartition par classe d'actifs (en % de l'exposition)

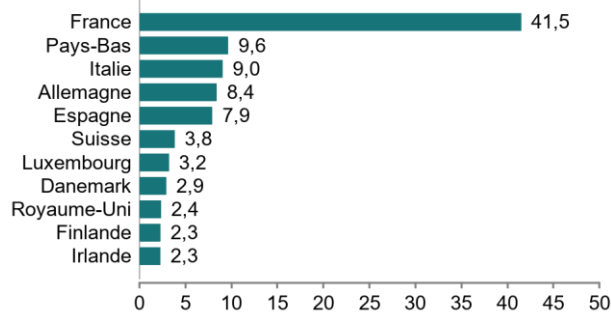


Analyse de la poche obligataire

Répartition par type d'émetteur (en % de la poche, hors liquidités)



Répartition géographique (en % de la poche, hors liquidités)



Analyse de la poche actions

Répartition sectorielle (en % de la poche, hors liquidités)



Répartition géographique (en % de la poche, hors liquidités)



Équipe de gestion

Florent VAUTIER

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.

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.

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.

Compartiment de GROUPAMA SELECTION 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).