

GROUPAMA DYNAMIC BOND MEDIUM TERM IC

FCP de droit français

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

L'objectif de gestion du produit est, par le biais d'une gestion active de type discrétionnaire, de chercher à obtenir, sur la durée de placement recommandée, une performance nette de frais supérieure à celle de son indicateur de référence, le Bloomberg Euro Aggregate 3 - 5 ans Total Return Index clôture coupons réinvestis, qui répondent à des caractéristiques ESG (Environnementales, Sociales et de Gouvernance).

Actif net global

697,31 M €

Valeur liquidative

1 018,53 €

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	GRDBMIC FP
Indicateur de référence	Bloomberg Euro Aggregate 3 - 5 ans Total Return Index clôture coupons réinvestis
Classification SFDR	Article 8
Date de création du fonds	14/05/2024
Date de création de la part	14/05/2024
Devise de valorisation	EUR
PEA	Non
PEA-PME	Non

Frais

Commission de souscription maximum	2,00%
Commission de rachat maximum	-
Frais de gestion directs maximum	0,60%
Frais de gestion indirects maximum	0,00%

SFDR 8**Intensité carbone****277 tCO2**

vs 484 pour l'univers

Part Verte**2% de l'actif net**

2% pour l'univers

Conditions de commercialisation

Fréquence de valorisation	Quotidienne
Type de part	Capitalisation
Minimum de première souscription :	-
Heure limite de centralisation	11:00, heure de Paris
Type de valeur liquidative	Inconnue
Règlement	J+2
Dépositaire / Conservateur	CACEIS BANK

GROUPAMA DYNAMIC BOND MEDIUM TERM IC

BLOOMBERG EURO AGGREGATE 3 - 5 ANS TOTAL RETURN INDEX CLÔTURE COUPONS RÉINVESTIS

PERFORMANCE DU PORTEFEUILLE

La part a été lancée le 2024-05-14. Conformément à la réglementation, les performances seront affichées à partir d'un an historique.

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	-	31/07/24	31/05/24	-	-	-	-
OPC	-	-	-	-	-	-	-
Indicateur de référence	-	-	-	-	-	-	-
Écart	-	-	-	-	-	-	-

Performances annuelles nettes en %

	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
OPC	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Indicateur de référence	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Ecart	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Source : Groupama AM

Analyse du risque

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans
Volatilité	-	-	-	-
Volatilité de l'indice de référence	-	-	-	-
Tracking Error (Ex-post)	-	-	-	-
Ratio d'information	-	-	-	-
Ratio de Sharpe	-	-	-	-
Coefficient de corrélation	-	-	-	-
Beta	-	-	-	-

Source : Groupama AM

GROUPAMA DYNAMIC BOND MEDIUM TERM IC

Aggregate

Données au 30/08/2024

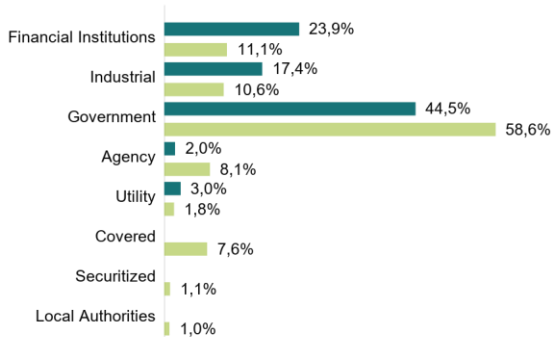
Profil de l'OPC

Nombre de lignes	121	Yield to maturity	3,0%
Nombre d'émetteurs	88	Sensibilité taux	2.3
Rating Moyen Portefeuille	BBB	Duration	2.3
		Dérivés crédit (en %)	0,00%

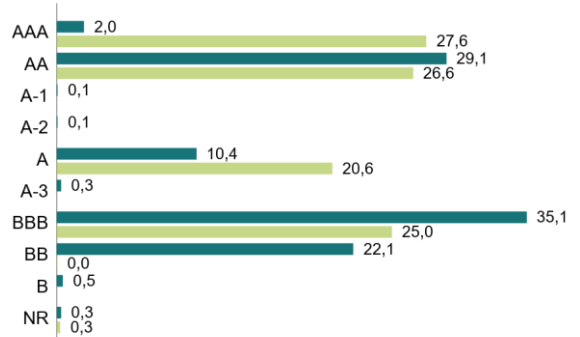
GROUPAMA DYNAMIC BOND MEDIUM TERM IC

BLOOMBERG EURO AGGREGATE 3 - 5 ANS TOTAL RETURN INDEX CLÔTURE COUPONS RÉINVESTIS

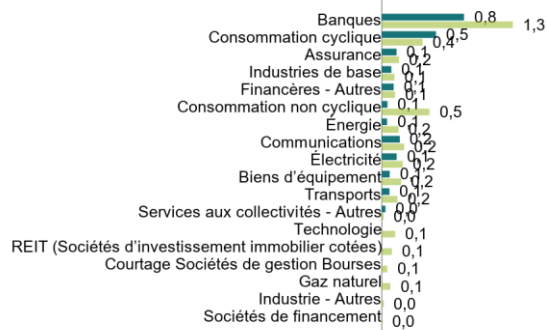
Répartition par classe d'actifs (en % de l'actif)



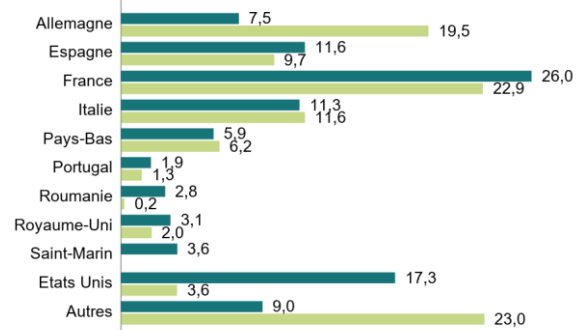
Répartition par notation (en % d'actif, hors liquidité)



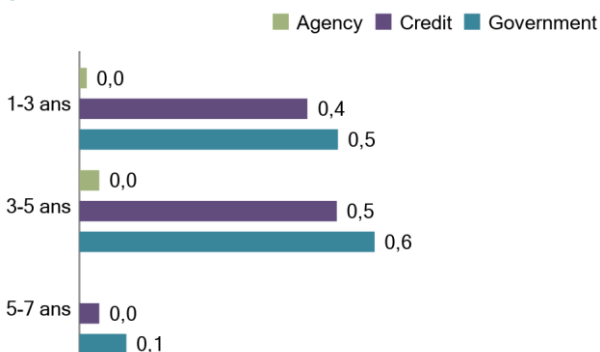
Répartition sectorielle en points de sensibilité (hors dérivés)



Répartition géographique (en % de l'actif)



Répartition de la sensibilité par secteur et par segment



Source : Groupama AM

Dix principales lignes en portefeuille (en % de l'actif)

	Pays	Secteur	% de l'actif
FRENCH REPUBLIC - Groupe	France	Bons du Trésor	6,3%
FRENCH REPUBLIC - Groupe	France	Bons du Trésor	5,9%
UNITED STATES OF AMERICA - Groupe	Etats Unis	Bons du Trésor	5,3%
UNITED STATES OF AMERICA - Groupe	Etats Unis	Bons du Trésor	4,7%
REPUBLIC OF ITALY - Groupe	Italie	Bons du Trésor	4,5%
KINGDOM OF SPAIN	Espagne	Bons du Trésor	3,9%
UNITED STATES OF AMERICA - Groupe	Etats Unis	Bons du Trésor	3,5%
REPUBLIC OF SAN MARINO	Saint-Marin	Emprunts d'État	3,2%
ROMANIA - Groupe	Roumanie	Emprunts d'État	2,5%
FEDERAL REPUBLIC OF GERMANY - Groupe	Allemagne	Bons du Trésor	1,9%
Total			41,8%

Source : Groupama AM

Équipe de gestion

Damien MARTIN

François FREYSSINIER

Arthur CUZIN

Source : Groupama AM



Indicateurs de performance ESG

Critères	Indicateur de performance ESG	Mesure		Taux de couverture(*)	
		OPC	Univers	OPC	Univers
Environnement	Intensité carbone (en tCO ²)	277	484	95%	93%
Social	Créations d'emploi (en %)	3%	2%	45%	97%
	Heures de formation (en heures)	30	25	40%	53%
Droits Humains	Politique en matière des Droits de l'Homme (en %)	98%	95%	45%	99%
Gouvernance	Indépendance des administrateurs (en %)	81%	52%	45%	99%

(*) Le taux de couverture correspond au pourcentage des valeurs qui contribuent à définir la note de l'indicateur ESG
 Pour les définitions des indicateurs de performances ESG, merci de se reporter en dernière page du document.

Score ESG du portefeuille

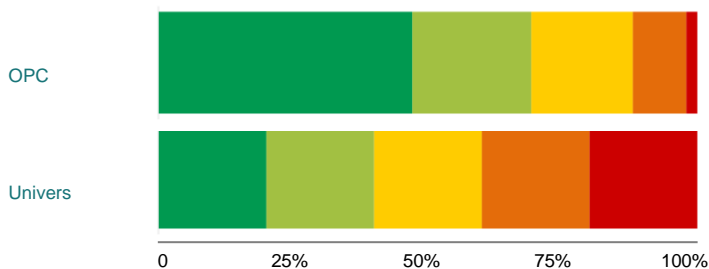


Les niveaux A B C D E sont la répartition des scores ESG de l'univers d'investissement en cinq portions égales (quintiles), A étant le meilleur score et E le moins bon.

Score des piliers E, S et G

	OPC	Univers
Environnement	76	60
Social	65	60
Gouvernance	52	60

Répartition du portefeuille par score ESG



Meilleures notes ESG du portefeuille

Valeur	Secteur	Poids	Note ESG
FRTR 5 1/2 04/25/29 - 25/04/29	Bons du Trésor	6,32%	A
FRTR 0.1 03/01/26 - 01/03/26	Bons du Trésor	5,87%	A
DBR 2.1 11/15/29 - 15/11/29	Bons du Trésor	1,88%	A
CLNXSM 1 7/8 06/26/29 - 26/06/29	Communications	0,67%	A
ACAAP 2.8 07/21/26 - 21/07/26	Banques	0,50%	A

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.

La Société de Gestion peut à tout moment décider de mettre fin à la commercialisation du Fonds dans une ou plusieurs juridictions.

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.

Suisse : la SICAV est en conformité avec la loi suisse portant sur la distribution à des investisseurs qualifiés en Suisse. Le Représentant local est ACOLIN Fund Services AG, Leutschenbachstrasse 50, CH-8050 Zurich et l'Agent payeurs des Compartiments enregistrés pour une offre publique en Suisse sont Banque Cantonale de Genève, Quai de l'Île, CH-1204 Genève ou BNP Paribas, Paris, succursale de Zürich, Selnaustrasse 16, 8002 Zürich. Le présent document peut être publié, transmis ou distribué, mais ne constitue pas une offre au public en Suisse. Les destinataires de ce document en Suisse ne doivent pas le transmettre à un tiers sans avoir au préalable consulté leur conseiller juridique ou autre conseiller professionnel ou encore le représentant.

Belgique : le Prospectus ainsi que le Document d'information pour l'investisseur disponible en français et les rapports annuel et semestriel en vigueur peuvent être obtenus auprès de CACEIS Bank, Belgium Branch, Avenue du Port 86, 1000 Brussels ou sur le site groupama-am.fr/be.

Allemagne : le Prospectus ainsi que le Document d'information pour l'investisseur disponible en allemand et les rapports annuel et semestriel en vigueur peuvent être obtenus auprès de CACEIS Germany, Lilienthalallee 36, 80939 Munich, Germany.

Portugal : le Prospectus ainsi que le Document d'information pour l'investisseur disponible en portugais et les rapports annuel et semestriel en vigueur peuvent être obtenus auprès de Bancobest, rue Castilho 26, Piso 2, 1250-069 Lisbon, Portugal.

Pays-Bas : le Prospectus ainsi que le Document d'information pour l'investisseur disponible en flamand et les rapports annuel et semestriel en vigueur peuvent être obtenus auprès Groupama AM.