

Exane Pleiade Fund (part B, Euro)

Long/short actions market neutral

Univers : Multi-secteurs

Code ISIN : LU0616900774 | Date de lancement : 30 mai 2011



Gérant : Eric Lauri

Description du fonds

Exane Pleiade vise à réaliser une performance absolue, régulière et peu corrélée avec les classes d'actifs traditionnelles.

Chiffres clés

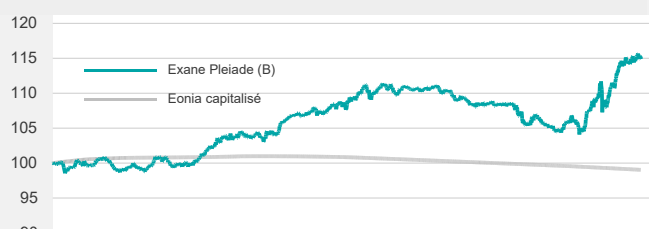
- ▶ Performance mensuelle : **0.38%**
- ▶ 2020 : **7.30%**
- ▶ VL (€) : **115,27**
- ▶ Actif net du fonds (Mio €) : **796**

Composition du portefeuille

	LONG	SHORT
Nombre de lignes	100	115
Contribution (bps)	-410	453
	Top 5 (poids)	Top 5 (poids)
	Sanofi	Novo Nordisk B
	Roche Holding AG	Fortum
	Engie	Equinor ASA
	Alcon Inc	ENI SpA
	National Grid PLC	Vestas Wind Systems

Performances

	12 mois	2 ans	3 ans	5 ans	Depuis création
Cumulées					
Exane Pleiade (B)	9.63%	6.67%	5.16%	6.86%	15.27%
Eonia capitalisé (*)	-0.46%	-0.84%	-1.20%	-1.85%	-0.96%
Annualisées					
Exane Pleiade (B)	9.63%	3.28%	1.69%	1.33%	1.52%
Eonia capitalisé (*)	-0.46%	-0.42%	-0.40%	-0.37%	-0.10%



*Le fonds cherche à restituer une performance absolue, régulière et décorrélée des marchés. L'eonia capitalisé n'est pas l'indicateur de référence du fonds.

Risques

	2 ans	Depuis création
Volatilité	3.8%	2.4%
Volatilité 12 mois min./max.	1.3% / 4.8%	1.2% / 4.8%
Ratio de sharpe	1,0	0,7

Contributions*/ expositions

	Exposition brute moyenne	Contribution nette
Santé	32.57%	-0.01%
Industries et construction	28.64%	-0.19%
Services aux collectivités	23.34%	0.33%
Energie	14.20%	0.07%
Technologie	11.11%	0.37%
Distribution	9.66%	-0.01%
Chimie	9.26%	-0.12%
Banques	8.35%	-0.10%
Telecoms	5.79%	0.11%
Médias	4.88%	-0.15%
Assurances	4.78%	0.05%
Sociétés de services personnels et professionnels	4.73%	-0.02%
Services financiers	3.74%	-0.06%
Autos et Equipements	3.57%	-0.01%
Immobilier	2.76%	0.08%
Produits ménagers et personnels	0.99%	0.07%
Produits de consommation durable	0.40%	-0.00%
Agroalimentaire et boissons	0.38%	0.03%
Ressources de base	0.11%	-0.03%
Total	169.25%	0.43%

Meilleures contributions	Contribution	Poids moyen
PROSUS NV	0.27%	2.16%
MERCK KGAA	0.27%	1.70%
EDF	0.24%	2.06%
ALCON INC	0.24%	3.27%
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	0.24%	2.89%

Pires contributions	Contribution	Poids moyen
BOOHOO GROUP PLC	-0.32%	1.14%
ENGIE	-0.31%	4.21%
NXP SEMICONDUCTORS NV	-0.25%	-1.36%
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	-0.20%	-2.21%
SPIE SA	-0.16%	1.39%

*Contribution en alpha : contribution relative du titre par rapport à son secteur dans la performance du fonds

	Mouvements acheteurs
GIVAUDAN-REG	1.58%
PROSUS NV	1.52%
SANOFI	1.34%
WEIR GROUP PLC/THE	1.30%
SONOVA HOLDING AG-REG	1.10%

	Mouvements vendeurs
SIKA AG-REG	-1.99%
COLOPLAST-B	-1.79%
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	-1.70%
TENCENT HOLDINGS LTD-UNS ADR	-1.05%
DEMANT A/S	-1.03%

Exposition du fonds	30 octobre 2020	Moyenne sur 12 mois
Long	91.1%	88.9%
Short	-84.3%	-86.1%
Brute	175.4%	175.0%
Nette/nette ajustée du beta	6.8% / 9.7%	2.8% / 5.3%
Top 5 des positions à l'achat	19.3%	18.1%

Historique des performances

	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014	2013	2012	2011
Janvier	+1.55%	+0.69%	-0.61%	+0.24%	-0.05%	+1.57%	+0.58%	+1.09%	-0.06%	-
Février	+0.34%	+0.25%	-0.27%	-0.19%	+0.47%	+0.43%	+0.66%	-0.57%	+0.84%	-
Mars	-0.61%	-0.93%	-0.01%	+0.18%	+0.27%	+0.39%	+0.19%	+0.29%	+0.15%	-
Avril	+1.26%	-0.32%	-0.14%	-0.39%	+0.74%	+0.39%	-0.13%	-0.97%	-0.72%	-
Mai	+0.51%	-0.35%	+0.23%	+0.24%	+0.68%	-0.25%	+0.73%	+0.43%	-0.98%	-
Juin	+3.03%	-0.19%	-0.26%	+0.13%	-1.20%	+0.01%	-0.70%	-0.05%	-0.06%	-0.10%
Juillet	+0.38%	+0.11%	+0.11%	+0.16%	+0.36%	+0.93%	+0.02%	-0.28%	+0.08%	0.00%
Août	-0.11%	+0.89%	+0.09%	-0.68%	+0.83%	-0.52%	+0.20%	+0.33%	+0.47%	-0.55%
Septembre	+0.40%	+0.15%	+0.03%	+0.14%	+0.08%	-0.12%	-0.29%	+0.58%	+0.01%	+0.01%
Octobre	+0.38%	-0.88%	-0.35%	-0.59%	+0.08%	+0.65%	+0.68%	+0.59%	-0.48%	+0.68%
Novembre	-	-0.24%	-0.79%	-0.51%	-1.02%	+0.55%	+0.08%	+1.13%	+0.13%	+0.23%
Décembre	-	+2.42%	-1.35%	+0.27%	+0.42%	+0.18%	-0.27%	+0.17%	+0.46%	-0.44%
Année	+7.30%	+1.58%	-3.27%	-1.00%	+1.65%	+4.27%	+1.76%	+2.76%	-0.17%	-0.17%

Depuis création

% de mois positifs	61.95%
Meilleure performance mensuelle	+3.03% juin 2020
Plus mauvaise performance mensuelle	-1.35% décembre 2018

	Stoxx 600*	Pleiade (b)*
Mois en hausse (66)	+2.78%	+0.26%
Mois en baisse (48)	-3.17%	-0.05%

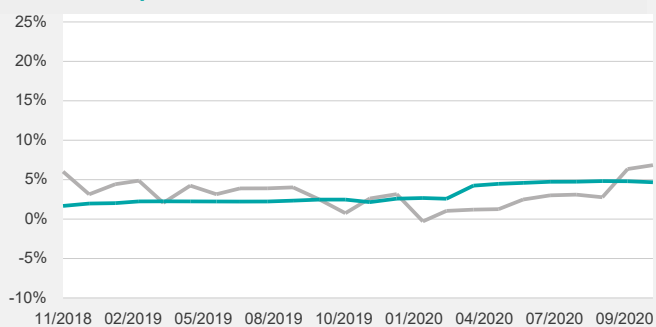
*Performances mensuelles moyennes

Exposition du fonds

(en % de l'actif net)

	Capitalisation Boursière < 5 Mds €	Capitalisation Boursière > 5 Mds €
Long	9.8%	81.4%
Short	-7.7%	-76.6%

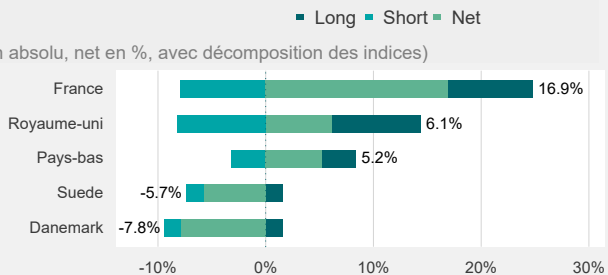
Volatilité et exposition nette du fonds sur 24 mois



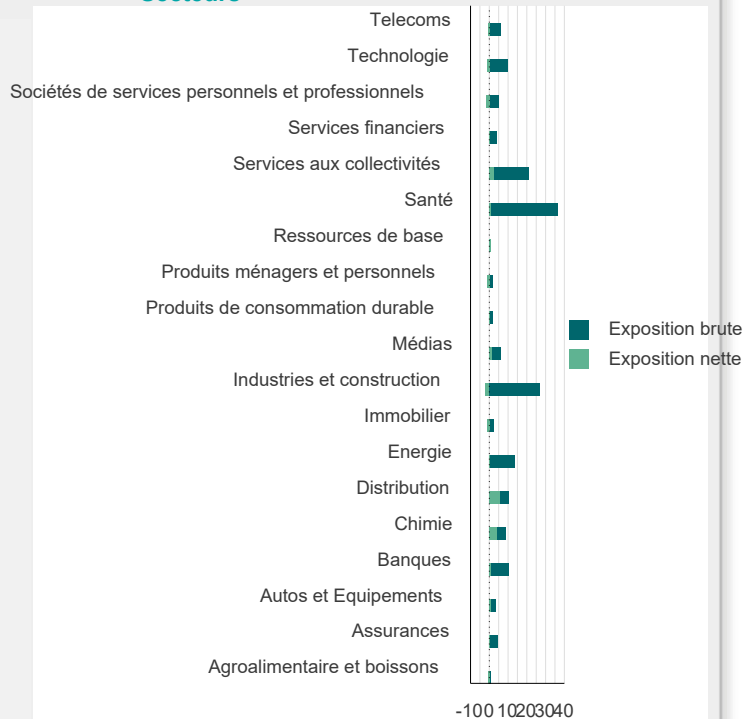
— Volatilité 12 mois
— Exposition nette

Pays

(top 5 en absolu, net en %, avec décomposition des indices)



Secteurs



Pour plus d'informations : www.exane-am.com

Avertissement : les performances passées ne préjugent pas des performances futures. Tout investissement peut générer des pertes ou des gains. Le présent document informatif ne constitue pas le prospectus de la SICAV et ne doit pas être considéré comme une offre commerciale, une sollicitation d'investissement ou le support d'un conseil en investissement. Toute souscription dans la SICAV ne peut être réalisée que sur la base du prospectus. L'investisseur est invité à se reporter à la rubrique facteurs de risques du prospectus. Exane cristal fund est immatriculé au Luxembourg et enregistré pour la commercialisation en Espagne, Italie, Belgique et Allemagne.