CPR FOCUS INFLATION - P

FR0010832469

RENTA FIJA - INFLACIÓN

31/07/2018

CARACTERISTICA

Fecha de creación del compartimento :
23/12/2009

Forma jurídica : Fondo de Inversión Francés

Norma europea : UCITS IV

AMF clasificación :
Obligaciones y títulos de crédito internacionales

Índice de referencia :
50% IBOXX USD BREAKEVEN 10-YEAR INFLATION + 50% IBOXX EUR BREAKEVEN 10-YEAR INFLATION FRANCE & GERMANY

Indice comparativo : -

Eligible para el PEA : No

Moneda : EUR

Asignación de los resultados :
Participaciones de Capitalización

Código ISIN : FR0010832469

Código Bloomberg : CPRFOIP FP

Duración mínima de la inversión : > 3 dias

Escala de riesgo (KIID según) :

Riesgo inferior — Major riesgo

1	2	3	4	5	6	7

Rendimiento potencialmente más débil — Rendimiento potencialmente más elevado

DATOS CLAVE

Valor liquidativo : 72,34 (EUR)

Activos : 1 253,86 (millones EUR)

Últimos cupones : -

ACTORES CLAVE

Sociedad gestora : CPR ASSET MANAGEMENT

Gestor principal :
Christophe Dehondt / Thierry Sarles

Depositario / Subdelegación financiera :
CACEIS Bank / CACEIS Fund Administration France

FUNCIONAMIENTO

Valoración : Diaria

Hora límite para las órdenes : 12:00

Fecha límite para las órdenes / Fecha de cálculo del valor de reembolso :
J / J+1

Importe mínimo de la primera suscripción :
1 Participación(es)

Importe mínimo de las suscripciones posteriores :
1 milésima parte departicipación

Gastos de entrada (máximo) : 1,00%

Gastos de salida : 0%

Gastos de gestión directos : 1,20%

Comisión de rentabilidad : Sí

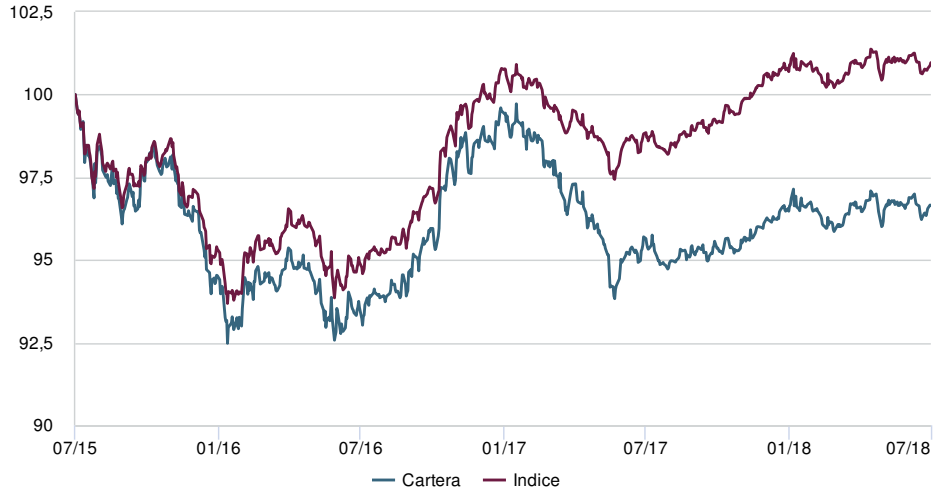
Todos los detalles están disponibles en la documentación jurídica

ESTRATEGIA DE INVERSION

Fondo de renta fija internacional indexada a la inflación que aspira a beneficiarse de los incrementos previstos de la inflación en EE.UU. y Europa; su objetivo es batir al índice de referencia en el plazo de inversión recomendado. El fondo invierte fundamentalmente en títulos emitidos por estados o entidades públicas, principalmente de la zona euro y EE.UU., y aplica coberturas para la sensibilidad a los tipos reales.

ANALISIS DE LA RENTABILIDAD

VARIACION (BASE 100)



RENTABILIDAD NETA [1]

	Desde el	1 mes	3 meses	1 año	3 años	3 años	10 Años
Desde el	29/12/2017	29/06/2018	30/04/2018	31/07/2017	31/07/2015	31/07/2013	-
Cartera	**0,57%**	**0%**	**0,07%**	**1,05%**	**-1,13%**	**-3,49%**	**-**
Índice	0,39%	-0,01%	0,04%	2,14%	0,32%	-1,54%	-
Diferencia	**0,18%**	**0,01%**	**0,03%**	**-1,09%**	**-1,45%**	**-1,95%**	**-**

[1] Los datos superiores a un año son anualizados.

RENTABILIDAD NETA POR ANO NATURAL [2]

	2017	2016	2015	2014	2013
Cartera	**-2,52%**	**2,17%**	**-5,09%**	**-9,87%**	**-6,20%**
Índice	**0,70%**	**2,85%**	**-2,40%**	**-7,75%**	**-4,09%**
Diferencia	**-3,23%**	**-0,68%**	**-2,69%**	**-2,12%**	**-2,11%**

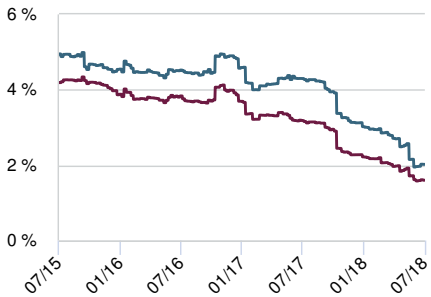
[2] La rentabilidad pasada no es constante y no constituye un indicador fiable de la rentabilidad futura. Las inversiones son sensibles a las fluctuaciones del mercado y pueden variar al alza como a la baja.

ANALISIS DEL RIESGO

	1 año	3 años	5 años
Volatilidad de la cartera	2,02%	3,80%	3,89%
Volatilidad del índice	1,60%	3,05%	3,17%
Tracking Error Ex Post Valeur PTF	0,67%	1,19%	1,35%
Ratio de información	-1,51	-1,17	-1,45
Sharpe ratio	0,70	-0,23	-0,88

Datos anualizados

VARIACIÓN DE LA VOLATILIDAD



CPR FOCUS INFLATION - P

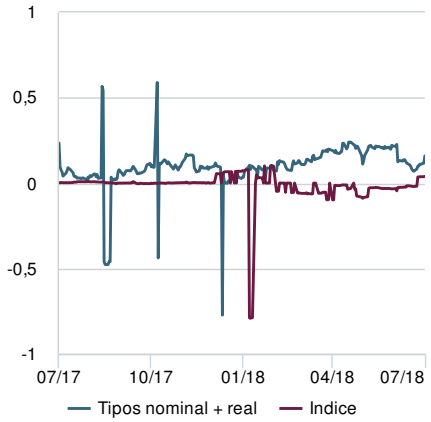
31/07/2018

CARTERA ANÁLISIS

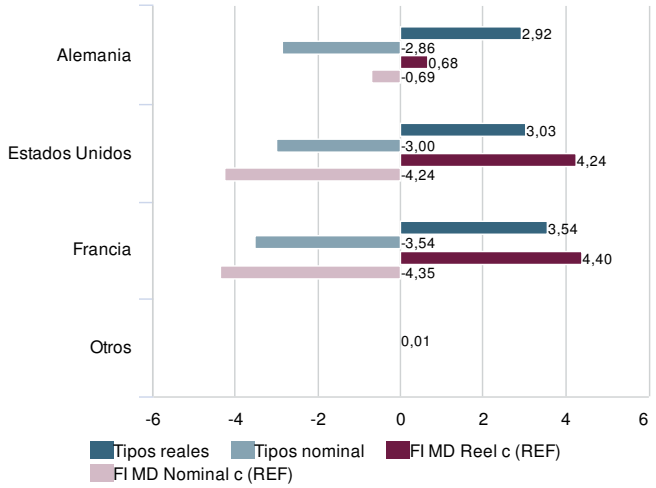
ANÁLISIS GLOBAL

	PTF	REF
Sensibilidad a los tipos de cambio	0,11	0,04
Sensibilidad del tipo nominal	-9,39	-9,29
Sensibilidad del tipo real	9,59	9,32
Sensibilité Breakeven Inflation	13,42	9,32
Plazo medio hasta el vencimiento (años)	14	-
LP puntuación media de agencia	AA	AA+
Número de valores en la cartera	31	-
Activos líquidos inf. 7 días	8,50%	-

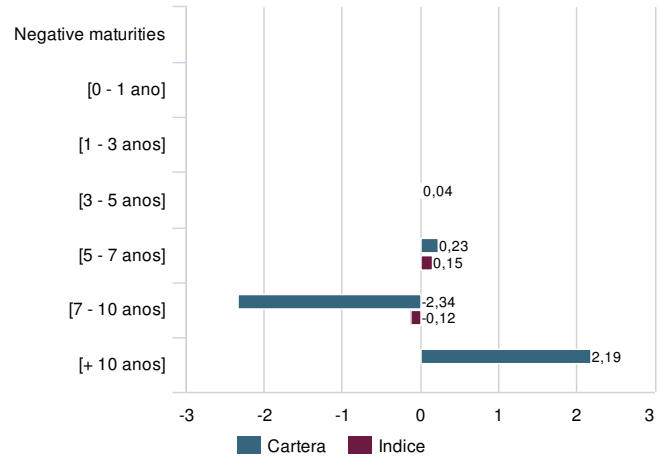
VARIACION DE LA SENSIBILIDAD DEL TIPOS



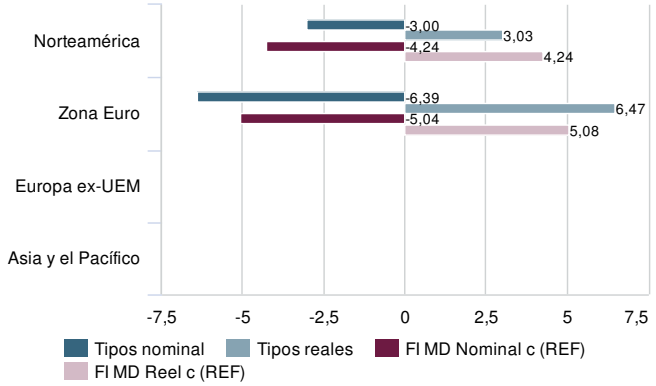
DESGLOSE DE LA SENSIBILIDAD A LOS TIPOS DE INTERÉS POR PAÍS



DESGLOSE DE LA SENSIBILIDAD A LOS TIPOS DE INTERÉS POR PLAZO DE VENCIMIENTO



DESGLOSE DE LA SENSIBILIDAD A LOS TIPOS DE INTERÉS POR MONEDA PLAZA



10 PRINCIPALES EMISORES

	Sector	Pais	Cartera
FRANCE	Bonos del estado	Francia	37,05%
ESTADOS UNIDOS	Bonos del estado	Estados Unidos	29,12%
ALEMANIA	Bonos del estado	Alemania	25,28%

La información y los datos financieros presentados por CPRAM no constituyen ni una oferta de suscripción ni un consejo personalizado. CPRAM no asumirá responsabilidad alguna por el uso que pueda hacerse de dicha información ni por sus consecuencias. La rentabilidad pasada no constituye una garantía de resultados futuros. La suscripción de un OICVM conlleva riesgos, que se definen en el folleto completo correspondiente.