

Informe Mensual a 30/09/2022

Índice de referencia : 15% MSCI World closing € (net dividend reinvested) 85% Bloomberg EuroAgg Total Return Unhedged EUR

CIFRAS CLAVE

Tamaño del fondo :	47,88 M €
Patrimonio :	0,34 M €
Valor Liquidativo a 30/09/22 :	649,84
Divisa de referencia :	EUR
Valoración :	Diaria

INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

Características

Categoría Morningstar :	Diversificado
Tipo de fondo :	UCITS
Fecha de creación :	15/04/1997
Ticker Bloomberg :	GPGANPN FP

Horizonte de inversión

Superior a 3 años

Condiciones de comercialización

Importe mínimo de la primera suscripción :	500 €
Siguientes suscripciones :	En diez milésima de participación
Centralizador :	CACEIS BANK
Condiciones de suscripción / reembolso :	Diaria a 09:00 - Valor Liquidativo desconocido - Reglamento D+3

Comisiones

Comisiones de suscripción máx :	4,00%
Comisiones de reembolso máx :	-
Comisiones de gestión directos máx :	1,05%
Comisiones de gestión indirectos máx :	1,05%

Se puede consultar el detalle de los gastos pertenecientes al fondo en el folleto.

BANDA DE DURACIÓN MODIFICADA

Min	Max
0,0	8,0

DATOS DE CONTACTO

GROUPAMA ASSET MANAGEMENT
Sucursal en España
Torre Europa. Paseo de la Castellana 95, Planta 28.
28046 Madrid - España
Tel : +34 914 184 798

Juan Rodríguez-Fraile - Country Manager Iberia & Latam
Jrodriguez-Fraile@groupama-am.es

Maya MONTES-JOVELLAR - Client Servicing - Marketing Iberia & Latam
MMontesJovellar@groupama-am.es

Sergio López de Uralde -Business Development Manager Iberia & Latam
slopezdeuralde@groupama-am.es

EVOLUCIÓN DE LA RENTABILIDAD

GAN PRUDENCE N Índice de referencia

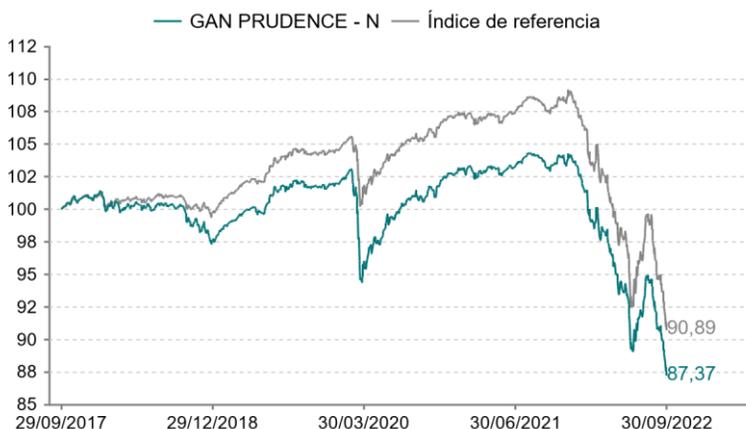
Rentabilidades anuales netas en % (5 años)

Año	2021	2020	2019	2018	2017
Fondo	0,53	0,99	4,22	-3,11	1,60
Índice de referencia	0,57	2,77	4,57	-1,05	1,71
Diferencia	-0,03	-1,78	-0,36	-2,05	-0,11

Rentabilidades netas acumuladas (en%)

Período	1 mes	3 meses	Año act	1 año	3 años	5 años
	31/08/22	30/06/22	31/12/21	30/09/21	30/09/19	29/09/17
Fondo	-3,99	-3,41	-15,44	-15,43	-14,41	-12,63
Índice de referencia	-4,17	-3,86	-15,70	-15,59	-13,10	-9,11
Diferencia	0,18	0,45	0,25	0,15	-1,30	-3,52

Rentabilidad 5 años (base 100)



* Las rentabilidades registradas en el pasado no son garantía para el futuro.No tienen en cuenta las posibles comisiones percibidas en las suscripciones o reembolsos de participaciones.

ANÁLISIS DE RIESGO (Sobre 1 año)

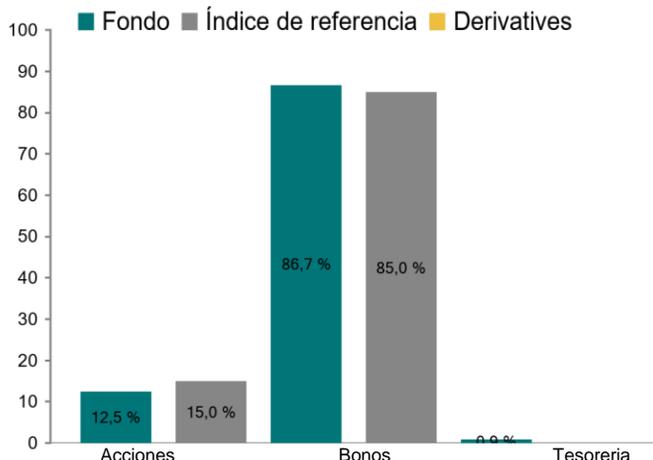
	Fondo	Índice de referencia
Volatilidad	6,41	7,13
Sharpe Ratio	-2,54	-2,30
Tracking Error (Ex-post)	1,30	-
Ratio de Información	0,11	-
Beta	0,89	-

ANÁLISIS DEL FONDO a 30/09/2022

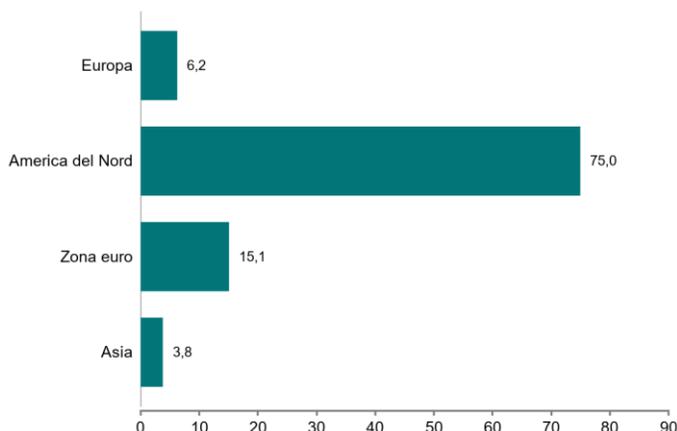
GAN PRUDENCE N

Índice de referencia

COMPOSICIÓN DEL ACTIVO (en % del exposición)



DISTRIBUCIÓN GEOGRÁFICA (en % de exposición de la parte de acciones)



RENTABILIDADES DE LOS PRINCIPALES FONDOS INTERNOS

Fondo	% del activo	Renta Año act. fondo	Renta Año act. indice de referencia	Diferencia	Renta 1 mes fondo	Renta 1 mes indice de referencia	Diferencia
GROUPAMA OBLIG EURO - O	19,22%	-15,96%	-16,16%	0,20%	-3,93%	-3,69%	-0,24%
GROUPAMA ETAT EURO ISR - O	14,88%	-16,39%	-16,69%	0,30%	-3,75%	-3,83%	0,07%
G FUND CREDIT EURO ISR - O	8,59%	-14,78%	-14,58%	-0,20%	-3,46%	-3,32%	-0,13%
GROUPAMA US EQUITIES - O	8,33%	-24,32%	-24,14%	-0,18%	-9,30%	-9,25%	-0,05%
GROUPAMA CREDIT EURO CT - OC	6,80%	-5,62%	-5,26%	-0,35%	-1,45%	-1,48%	0,03%

ANTECEDENTES DE LA RENTABILIDAD * EN % (5 AÑOS)

	Enero	Febrero	Marzo	Abril	Mayo	Junio	Julio	Agosto	Septiembre	Octubre	Noviembre	Diciembre	Año
2022 Fondo	-1,83	-2,26	-0,94	-3,22	-1,48	-3,39	4,70	-3,91	-3,99				-15,44
Índice de referencia	-1,54	-2,29	-1,29	-3,40	-1,50	-2,95	5,12	-4,57	-4,17				-15,70
2021 Fondo	0,08	-0,47	0,43	0,30	-0,12	0,25	0,77	0,13	-0,85	0,28	-0,11	-0,16	0,53
Índice de referencia	-0,01	-0,65	0,38	0,22	0,00	0,27	0,89	0,13	-0,79	0,30	0,36	-0,54	0,57
2020 Fondo	0,66	-1,11	-5,24	1,89	0,60	0,85	1,14	0,64	-0,17	0,20	1,48	0,22	0,99
Índice de referencia	0,81	-0,65	-2,49	1,12	0,57	0,52	0,87	0,38	0,08	0,09	1,23	0,25	2,77
2019 Fondo	0,95	0,52	0,55	0,54	-0,49	1,35	0,76	0,37	-0,10	-0,33	0,14	-0,11	4,22
Índice de referencia	0,98	0,47	0,69	0,44	-0,25	1,17	0,73	0,56	-0,04	-0,28	0,19	-0,17	4,57
2018 Fondo	0,25	-0,57	-0,58	0,44	-0,37	-0,08	0,43	0,07	-0,09	-1,51	0,03	-1,15	-3,11
Índice de referencia	0,06	-0,28	-0,03	0,22	-0,30	0,17	0,25	0,11	-0,06	-0,89	0,26	-0,57	-1,05

* Las rentabilidades registradas en el pasado no son garantía para el futuro. No tienen en cuenta las posibles comisiones percibidas en las suscripciones o reembolsos de participaciones.

HISTÓRICO DE MODIFICACIONES DEL INDICADOR DE REFERENCIA (5 AÑOS)

11/07/2017 - 24/08/2021	50% EONIA capitalized D-1 40% Barclays Capital Euro Aggregate closing D-1 10% MSCI World Hedged Euro (net dividend reinvested) D-1
24/08/2021 - 25/11/2021	50% EONIA capitalized D-1 40% Bloomberg Euro Aggregate closing D-1 10% MSCI World Hedged Euro (net dividend reinvested) D-1
25/11/2021	15% MSCI World closing € (net dividend reinvested) 85% Bloomberg EuroAgg Total Return Unhedged EUR

Todos los datos procedentes de fuentes externas son revisados y tratados por Groupama Asset Management.

Las informaciones contenidas en el presente documento únicamente se transmiten a título informativo. Los equipos comerciales de Groupama Asset Management y sus filiales están a su disposición con el fin de facilitarles una recomendación personalizada. Cualquier utilización o difusión no autorizada, total o parcial de cualquier tipo, está prohibida. Groupama Asset Management y sus filiales no se responsabilizan en caso de alteración, deformación o falsificación de la que este mensaje podría ser objeto. Las informaciones contenidas en esta publicación se basan en fuentes que consideramos fiables, pero no garantizamos que sean exactas, completas, válidas u oportunas. Este documento no contractual no constituye en ningún caso una recomendación, una solicitud de oferta de compra, de venta o de arbitraje, y no en ningún caso debe interpretarse como tal. Todos los inversores deben tener conocimiento, antes de tomar una decisión de inversión, del folleto de inversión / reglamento o documento de datos fundamentales para el inversor (DFI) del fondo. Estos documentos y el informe periódico más reciente están disponibles a petición en Groupama Asset Management.

Informe Mensual a 30/09/2022

Estrategia de inversión MSG

El objetivo del OICVM es proponer una asignación flexible entre clases de activos (Acciones y Tipos) a través de una selección de IIC gestionadas activa y pasivamente y que cuenten con la etiqueta pública ISR para al menos el 90% de ellas.



● Fonds labélisés : 91,07%
● Fonds non labélisés : 8,93%



ISIN	Libellé du fonds	Classe d'actif	Label ISR	% de l'actif net
LU2182388236	AMUNDI INDEX EURO AGG SRI-C	Bonos	Si	19,46%
LU1602144906	AMUNDI MSCI PAC EXJ SRI PA-C	Acciones	Si	0,45%
LU1437017863	AMUNDI S&P 500 ESG UCITS ETF	Acciones	Si	0,05%
LU2233156749	AMUN MSCI JAPAN SRI PAB	Acciones	Si	0,77%
LU2244386053	BNPP HY SRI FF UCITS ETF C	Bonos	Si	2,49%
LU1501411687	G FUND - AVENIR EUROPE - OD	Acciones	Si	0,43%
FR0013229721	G FUND CREDIT EURO ISR - O	Bonos	Si	8,66%
LU1717592692	G FUND - GLOBAL INFLATION SHORT DURATION - OC	Bonos	No	2,59%
FR0013073806	G FUND OPPORTUNITIES EUROPE - O	Acciones	Si	0,24%
LU1717594557	G FUND - TOTAL RETURN ALL CAP EUROPE - OC	Acciones	Si	0,25%
LU1897556608	G FUND - WORLD (R)EVOLUTIONS - OD	Acciones	No	0,87%
FR0010890483	GROUPAMA CREDIT EURO CT - OC	Bonos	Si	6,86%
FR0010973131	GROUPAMA ETAT EURO ISR - O	Bonos	Si	15,02%
FR0010890889	GROUPAMA ETAT EURO - O	Bonos	No	3,45%
FR0012097319	GROUPAMA EUROPE EQUITIES - O	Acciones	Si	0,59%
FR0013283496	GROUPAMA OBLIG EURO - O	Bonos	Si	19,39%
FR0012599645	GROUPAMA ULTRA SHORT TERM BOND - IC	Bonos	Si	1,24%
FR0013229739	GROUPAMA US EQUITIES - O	Acciones	Si	8,40%
IE00B3DKXQ41	ISHARES EURO AGGREGATE ESG	Bonos	No	1,51%
IE00BYZTVT56	ISHARES EURO CORP ESG UCITS	Bonos	Si	6,74%
IE00B52SF786	ISHARES MSCI CANADA ACC	Acciones	No	0,51%