

Informe Mensual a 30/09/2021

Índice de referencia : Eonia Capitalised

CIFRAS CLAVE

| | |
|--------------------------------|------------|
| Tamaño del fondo : | 470,22 M € |
| Patrimonio : | 384,17 M € |
| Valor Liquidativo a 30/09/21 : | 1 117,85 |
| Divisa de referencia : | EUR |
| Valoración : | Diaria |

INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

Características

| | |
|---------------------|----------------------------|
| Categoría : | Unconstrained Fixed Income |
| Tipo de fondo : | UCITS |
| Fecha de creación : | 06/12/2010 |
| Ticker Bloomberg : | GFALFID LX |

Condiciones de comercialización

| | |
|--|---|
| Importe mínimo de la primera suscripción : | 150 000 € |
| Siguientes suscripciones : | En milésima de participación |
| Centralizador : | CACEIS BANK, Luxembourg branch |
| Condiciones de suscripción / reembolso : | Diaria a 12:00 - Valor Liquidativo desconocido - Reglamento D+3 |

Comisiones

| | |
|--------------------------------------|-------|
| Comisiones de suscripción máx : | 4,00% |
| Comisiones de reembolso máx : | - |
| Comisiones de gestión directos máx : | 0,50% |

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

* 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.

DATOS DE CONTACTO

Gestores



Laurent FABIANI-LAGARDE

GROUPAMA ASSET MANAGEMENT
Sucursal en España
Plaza Carlos Trías Bertrán 4. 2ª Planta
28 020 Madrid - España
Tel : +34 914 184 798

Olivier LE BRAZ - Country Head Iberia & Latam
olebraz@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

G FUND - ALPHA FIXED INCOME IC Índice de referencia

Rentabilidades anuales netas en % (5 años)

| Año | 2020 | 2019 | 2018 | 2017 | 2016 |
|----------------------|-------|-------|-------|-------|-------|
| Fondo | 0,84 | 2,31 | -1,82 | 0,71 | 1,68 |
| Índice de referencia | -0,46 | -0,39 | -0,36 | -0,36 | -0,32 |
| Diferencia | 1,30 | 2,70 | -1,46 | 1,07 | 2,01 |

Rentabilidades netas acumuladas (en%)

| Período | 1 mes | 3 meses | Año act | 1 año | 3 años | 5 años |
|----------------------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|
| | 31/08/21 | 30/06/21 | 31/12/20 | 30/09/20 | 28/09/18 | 30/09/16 |
| Fondo | 0,10 | 0,25 | 0,55 | 1,11 | 2,49 | 1,93 |
| Índice de referencia | -0,04 | -0,12 | -0,36 | -0,48 | -1,30 | -2,00 |
| Diferencia | 0,14 | 0,38 | 0,91 | 1,58 | 3,79 | 3,93 |

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 DEL FONDO a 30/09/2021

G FUND - ALPHA FIXED INCOME IC

Índice de referencia

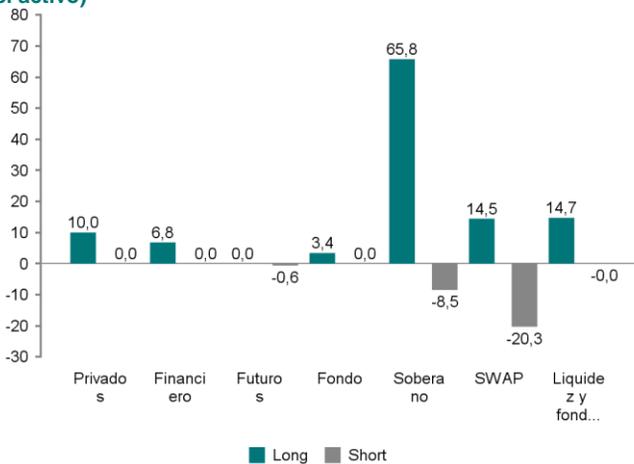
EXPOSICIÓN DEL FONDO (en % del exposición)

| Instrumentos | Peso |
|------------------------------|------|
| Bonos | 82,6 |
| CDS Single Name | -2,9 |
| Índice de CDS | -3,0 |
| Futuros | -9,1 |
| Liquidez y fondos monetarios | 18,1 |

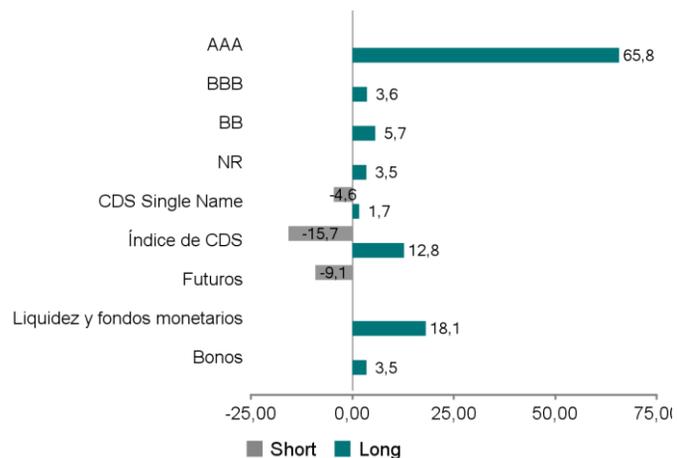
DESGLOSE POR ESTRATEGIAS (en % del activo)

| clase de activo | Peso medio MTD | Peso medio YTD |
|----------------------|----------------|----------------|
| Cartera Core | 91,1 | 90,8 |
| Estrategias de Alpha | 8,9 | 9,2 |
| Total | 100 | 100 |

DESGLOSE POR TIPO DE EMISORES (en % de exposición del activo)



DESGLOSE POR RATING (en % de exposición del activo)



ANÁLISIS DEL RIESGO

| | 1 año | 3 años | 5 años |
|--------------------------|-------|--------|--------|
| Volatilidad | 0,5 | 1,2 | 1,0 |
| Sharpe Ratio | 3,1 | 1,0 | 0,8 |
| Tracking Error (Ex-post) | 0,5 | 1,2 | 1,0 |
| Ratio de Información | 3,1 | 1,0 | 0,8 |
| Duración global | 0,4 | | |
| Yield to Maturity | -0,76 | | |



ADVERTENCIA LEGAL

Este documento está destinado exclusivamente a la atención de inversores institucionales, profesionales o cualificados y distribuidores. Cualquier inversor debe ser, en la Unión Europea, un inversor "Profesional" como se define en la Directiva 2004/39/EC del 21 de abril de 2004 sobre Mercados de Instrumentos Financieros ("MiFID") o como pueda ser el caso en cada legislación local y, en lo que a la oferta en Suiza se refiere, un "Inversor Cualificado" en el sentido de la Orden Suiza de Inversión Colectiva del 23 de junio de 2006 (CISA), la Orden de Inversión Colectiva del 22 de noviembre de 2006 (CISO) y la Circular 08/8 de la FINMA sobre la Oferta Pública en el sentido de la legislación sobre instituciones de inversión colectiva del 20 de noviembre de 2008. Este documento no puede ser distribuido en la Unión Europea a inversores no "Profesionales" como se define en la MiFID o en cada legislación local, o en Suiza a inversores que no cumplen con la definición de "Inversores Cualificados" como se define en la regulación y legislación aplicable. Por lo tanto, no se va a distribuir al público general, clientes privados o inversores particulares en ninguna jurisdicción incluyendo "Personas Estadounidenses". Este documento contiene información sobre el G FUND - ALPHA FIXED INCOME (el "Subfondo"), un Subfondo de G Fund (la "SICAV"), una sociedad de inversión colectiva en valores mobiliarios existentes en la Parte I de la Ley luxemburguesa del 20 de diciembre de 2002, organizada en forma de sociedad de inversión de capital variable e inscrita en el Registro de Comercio y de Sociedades de Luxemburgo con el número B157527. La SICAV tiene su domicilio social en 5, allée Scheffer, L-2520 Luxembourg.

G Fund ha sido autorizada para la venta pública por la Comisión de Supervisión del Sector Financiero de Luxemburgo (CSSF). No todos los Subfondos de la SICAV necesariamente serán registrados o autorizados para su venta en todas las jurisdicciones o estarán disponibles para todos los inversores.

Las suscripciones en los Subfondos sólo se aceptarán sobre la base de los últimos folletos completo y simplificado de la SICAV, junto con los últimos informes anuales y semestrales y sus artículos de incorporación que se pueden obtener, de forma gratuita, en el domicilio social de la SICAV o ,respectivamente, en la oficina del agente representante debidamente autorizado y aprobado por la autoridad competente de cada jurisdicción en cuestión. La inversión en la SICAV conlleva riesgos. Se debe considerar si los riesgos asociados a una inversión en los Subfondos son adecuados para inversores potenciales que deberían garantizar que son plenamente conscientes de los contenidos de este documento. Un asesor profesional debe ser consultado para determinar si una inversión en el Subfondo es adecuada.

Los Subfondos no tienen rentabilidades garantizadas. El valor de una inversión en los Subfondos puede tanto disminuir como aumentar. Además, las rentabilidades pasadas no son una garantía ni un indicador fiable de las rentabilidades actuales o futuras. Los datos de rentabilidad no tienen en cuenta las comisiones y costes incurridos en la emisión y reembolso de participaciones. Este documento no constituye publicidad oficial o consejo de inversión, ni tampoco constituye una oferta de venta ni una solicitud para vender en cualquier país en el que podría ser considerado como ilegal.

La información contenida en este documento se proporciona únicamente con fines informativos y por lo tanto no es vinculante para su autor. Puede ponerse en contacto con los equipos de ventas de Groupama Asset Management y sus filiales para una recomendación personalizada.