

CARACTERISTICA (Fuente : Grupo Amundi)

Fecha de creación del compartimento : 29/08/2014
 Forma jurídica : SICAV Luxemburguesa
 Norma europea : UCITS IV
 AMF clasificación : Diversificado
 Índice de referencia : 100% €STR CAPITALISE (OIS)
 Eligible para el PEA : No
 Moneda : EUR
 Asignación de los resultados :
 Participaciones de Capitalización
 Código ISIN : LU1103787690
 Código Bloomberg : CPRRCAC LX
 Duración mínima de la inversión : Superior a 4 años
 Escala de riesgo (KIID según) :



DATOS CLAVE (Fuente : Grupo Amundi)

Valor liquidativo : 1 161,84 (EUR)
 Activos : 148,82 (millones EUR)
 Últimos cupones : -

ACTORES CLAVE (Fuente : Grupo Amundi)

Sociedad gestora : CPR ASSET MANAGEMENT
 Custodio / Subdelegación financiera :
 CACEIS Bank, Luxembourg Branch / CACEIS Fund
 Administration Luxembourg

FUNCIONAMIENTO (Fuente : Grupo Amundi)

Valoración : Diaria
 Hora límite para las órdenes : 09:00
 Fecha límite para las órdenes : D
 Fecha valor suscripción / Fecha valor compra :
 D+2 / D+2
 Importe mínimo de la primera suscripción :
 1 diez-milésima parte (s) / acción (s)
 Importe mínimo de las suscripciones posteriores :
 1 diez-milésima parte (s) / acción (s)
 Gastos de entrada (máximo) / Gastos de salida :
 5,00% / 0,00%
 Gastos de gestión directos : 1,35%
 Gastos administrativos : 0,30%
 Comisión de rentabilidad : Sí

Todos los detalles están disponibles en la documentación jurídica

ESTRATEGIA DE INVERSION (Fuente : Grupo Amundi)

Este compartimento diversificado internacional trata de obtener, en un horizonte mínimo de cuatro años, una rentabilidad superior a la de su índice de referencia, con una volatilidad máxima prevista del 15%. La exposición de la cartera a renta variable oscila entre el 20% y el 80% y su sensibilidad a los tipos entre 0 y 5. Se trata de un compartimento subordinado del fondo de inversión colectiva de derecho francés CPR Croissance Réactive.

ANALISIS DE LA RENTABILIDAD (Fuente: Fund Admin)

VARIACION (BASE 100) (Fuente: Fund Admin)



RENTABILIDAD NETA (Fuente: Fund Admin) ¹

Desde el	Desde el 31/12/2021	1 mes 30/11/2022	3 meses 30/09/2022	1 año 31/12/2021	3 años 31/12/2019	3 años 29/12/2017	Desde el 18/04/1997
Cartera	-6,73%	-2,66%	0,12%	-6,73%	0,89%	0,19%	4,57%
Índice	-5,08%	0,13%	0,30%	-5,08%	4,46%	5,49%	5,38%
Diferencia	-1,65%	-2,79%	-0,18%	-1,65%	-3,57%	-5,30%	-0,81%

¹ Los datos superiores a un año son anualizados.

RENTABILIDAD NETA POR AÑO NATURAL (Fuente: Fund Admin)

	2022	2021	2020	2019	2018
Cartera	-6,73%	7,05%	2,86%	6,28%	-7,51%
Índice	-5,08%	12,92%	6,34%	16,92%	-1,96%
Diferencia	-1,65%	-5,87%	-3,48%	-10,64%	-5,55%

ANALISIS DEL RIESGO (Fuente: Fund Admin)

	1 año	3 años	5 años	Desde el lanzamiento
Volatilidad de la cartera	5,86%	7,69%	6,85%	8,43%
Volatilidad del índice	2,29%	8,75%	7,73%	8,22%
Sharpe ratio	-1,17	0,15	0,06	-
Coefficientes de Sharpe de la indice	-2,32	0,53	0,74	-
Maximum drawdown Valeur PTF	-9,00%	-12,90%	-14,83%	-35,19%
Maximum drawdown Valeur BENCH	-5,69%	-17,01%	-17,01%	-30,24%

Datos anualizados

Análisis de la cartera principal (Fuente : Grupo Amundi)

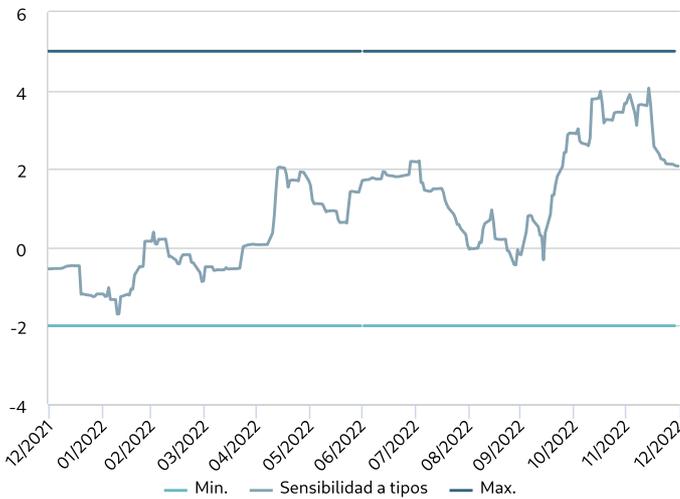
Síntesis (Fuente : Grupo Amundi)

	PTF
Exposición a renta variable	19,81%
Sensibilidad a tipos	2,07
Total emisores (excl activos liquido)	28

Evolución de la exposición de acciones (m-1) **-12,99%**

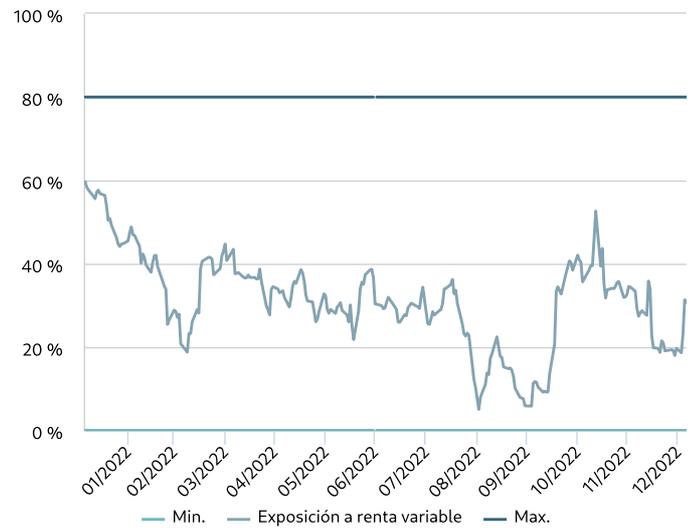
Evolución de la sensibilidad a la velocidad (m-1) **-1,60**

VARIACIÓN DE LA SENSIBILIDAD A LOS TIPOS DE INTERÉS (Fuente : Grupo Amundi)



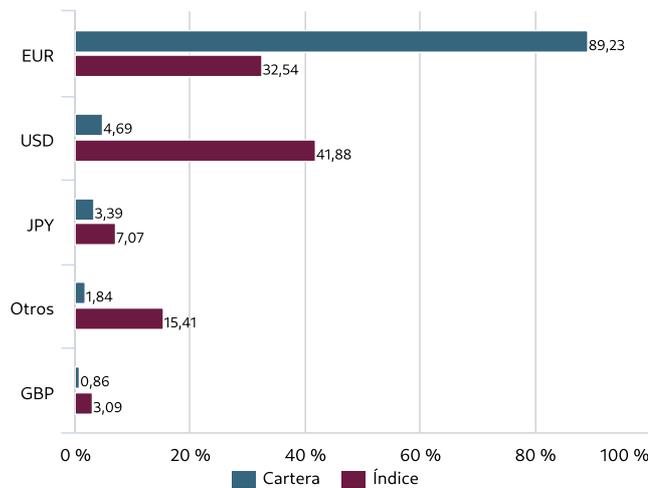
Puntos de sensibilidad, incluidos los instrumentos derivados

Evolución Exposición a renta variable (Fuente : Grupo Amundi)



Como porcentaje del activo, incluidos los instrumentos derivados

EXPOSICIÓN SOBRE PRINCIPALES MONEDAS (Fuente : Grupo Amundi)



PRINCIPALES LÍNEAS (Fuente : Grupo Amundi)

	Sector	Peso
AM ID MSCI EMU-UC ETF DR-EUR PARIS	Renta variable UEM	12,78%
AMUNDI INDEX US CORP SRI - UCITS ETF - H	Investment Grade USA	12,50%
CPR MONETAIRE ISR -I-	Instrumentos de mercados monetarios	12,06%
CPR USA ESG - H-I EUR	Renta variable EE. UU.	9,65%
AMUNDI US ESG LD ETF(GER)	Renta variable EE. UU.	5,50%
AMND TOPIX DV ETF(PAR)	Renta variable Japón	5,02%
AMUNDI PRIME EURO CORPORATES	Investment grade (UEM)	5,00%
X MSCI USA ESG ETF(GER)	Renta variable EE. UU.	4,84%
CPR OBLIG 12 MOIS - I C	Crédito de rentabilidad absoluta	3,89%
LYXOR CHINA ENTERPRISE ETF(PAR)	Equities Emerging Asia	3,62%

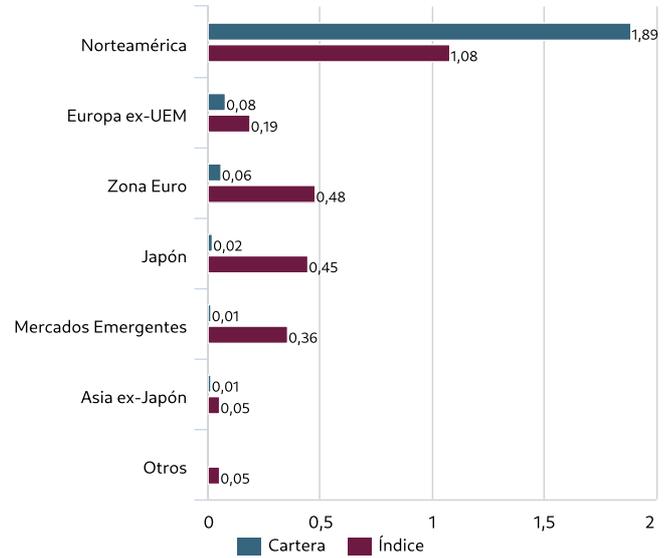
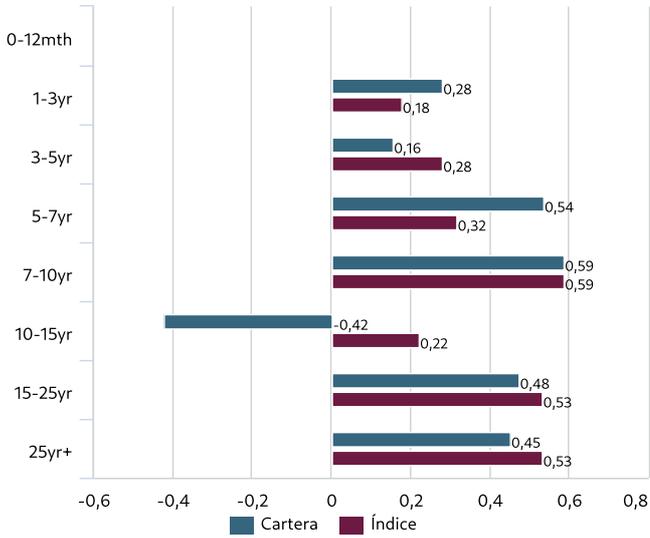
Excepto instrumentos derivados

ANÁLISIS DE SENSIBILIDAD DE TASAS (Fuente : Grupo Amundi)

Sensibilidad a tipos 2,07

Desglose de la cartera por vencimiento (Fuente : Grupo Amundi) *

Distribución geográfica (Fuente : Grupo Amundi)



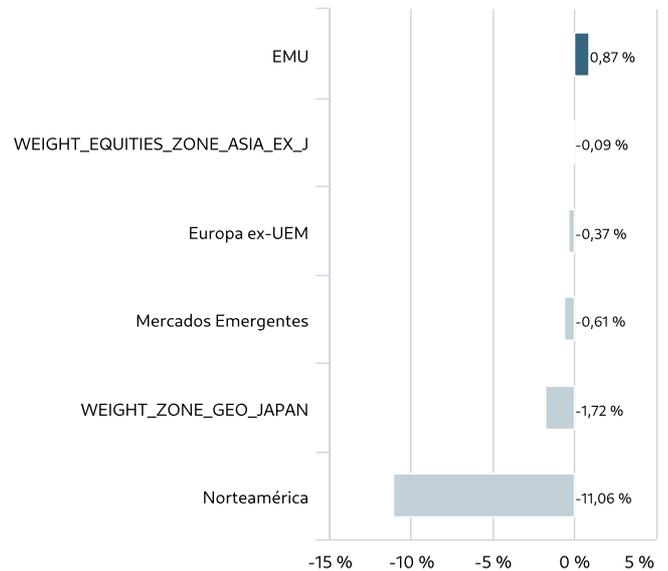
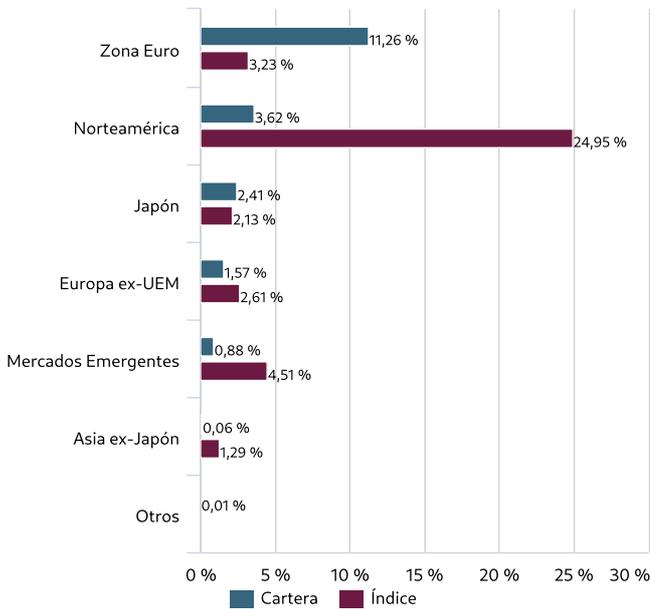
* Puntos de sensibilidad, incluidos los instrumentos derivados

ANÁLISIS DE LA EXPOSICIÓN DE ACCIONES (Fuente : Grupo Amundi)

Exposición a renta variable 19,81%

DESGLOSE POR ZONA GEOGRÁFICA (Fuente : Grupo Amundi) *

MOVIMIENTOS GEOGRÁFICOS DURANTE EL MES (Fuente : Grupo Amundi)



* Como porcentaje del activo, incluidos los instrumentos derivados

Equipo de inversión



Malik Haddouk

Responsable de la gestión Multi-Asset



Cyrille Geneslay

Gestor de cartera



Samir Saadi

Gestor de cartera

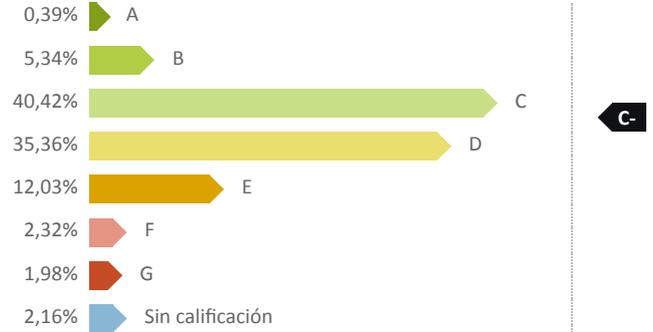
Calificación ESG general

Calificación medioambiental, social y de gobernanza

Cartera



Índice de referencia



Clasificación por componente E, S y G

	Cartera	Índice
Medio ambiente	C	C-
Social	C-	C-
Gobernanza	C-	C-
Calificación general	C	C-

Clasificación por componente E, S y G

Número de emisores	33
% de la cartera clasificada ESG ²	98,05%

²Valores en circulación con arreglo a los criterios ESG, excluidos los activos cash. El filtro adicional sobre controversias ESG permite cubrir el 100% de los valores del universo y de la cartera.

Definiciones y fuentes

Inversión responsable (IR)

IR expresa los objetivos de desarrollo sostenible en las decisiones de inversión añadiendo criterios medioambientales, sociales y de gobernabilidad (ESG) además de los criterios financieros tradicionales.

Por lo tanto, IR busca equilibrar el rendimiento económico y el impacto social y ambiental de las compañías y entidades públicas que contribuyen al desarrollo sostenible, independientemente de su sector de actividad. A través de la influencia en la gobernanza y el comportamiento de los grupos de interés, la ISR promueve una economía responsable.

Criterios ESG

Los criterios extra financieros se utilizan para evaluar las prácticas medioambientales, sociales y de gobernanza de compañías, estados o autoridades locales:

o "E" de Medio Ambiente: consumo de energía y emisiones de gases de efecto invernadero, gestión del agua y de los residuos, etc.

o "S" de Social: derechos humanos, salud y seguridad, etc.

o "G" de Gobernanza: independencia del consejo de administración, respeto de los derechos de los accionistas, etc.

Las calificaciones del Grupo Amundi van de A a G, siendo A la más alta y G la más baja.