

Prevaal Diversifié

FR0011521871

Reporting mensuel • 31 août 2023

Actif net du fonds

24,4 M€

Valeur liquidative de la part

1 144,18 €

Catégorie Morningstar

**Allocation EUR Flexible -
International**

Classification AMF

Sans classification

Échelle de risque et de
rendement

1 2 **3** 4 5 6 7

Classification SFDR

6 8 9

Objectif d'investissement

Prevaal Diversifié a pour objectif de surperformer l'Euribor 3 mois capitalisé + 1,00% sur un horizon de placement supérieur à 3 ans.

Stratégie d'investissement

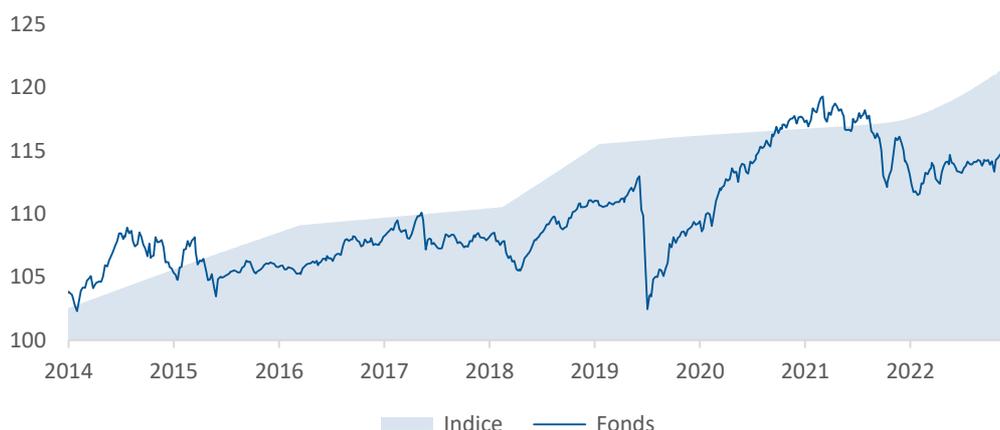
La gestion allocataire, basée sur une analyse des risques et un processus de sélection dynamique, conduit à arrêter l'exposition cible du portefeuille aux principaux marchés taux, crédit, actions, matières premières et devises; ainsi que sur les zones géographiques mondiales. Les actifs sont principalement composés de fonds et trackers, ainsi que d'obligations convertibles, obligations privées et d'actions.

Commentaires de gestion

Au cours de la période, l'environnement de marché a continué d'être marqué par le rythme particulièrement rapide de resserrement monétaire de part et d'autre de l'Atlantique cette année. Dans ce contexte de marché, la valeur du portefeuille a baissé de 0,30%, les poches actions et high yield ayant pesé négativement sur le fonds. Au cours du mois, nous avons allégé le poids des obligations convertibles via la vente de Lufthansa 2% 2025 et Rag Evonik 0% 2024. Nous avons par ailleurs renforcé le poids de la poche action via l'introduction de l'ETF iShares Core Euro Soxx 50 dans le portefeuille.

Performances

DEPUIS CRÉATION (base 100)



La catégorie de l'indicateur Synthétique de risque repose sur des données historiques. En raison de son exposition aux marchés d'actions, le Fonds peut subir une volatilité significative, que son classement dans l'indicateur susmentionné reflète. Pour de plus amples renseignements, veuillez-vous référer à la section détaillant les risques spécifiques, située dans le prospectus. Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures. Les performances sont calculées nettes de frais de gestion. Les OPCVM ne sont pas garantis en capital. Pour plus d'informations, le prospectus, le DIC, les rapports annuels et semestriels sont disponibles sur notre site internet www.prevaalfinance.fr. Ce document est destiné à des clients professionnels. Il ne peut être reproduit, diffusé, communiqué, en tout ou partie, sans autorisation préalable de la société de gestion.

Source : CACEIS, Bloomberg, Morningstar®, Prevaal Finance

Prevaal Diversifié

FR0011521871

Reporting mensuel • 31 août 2023

CARACTÉRISTIQUES

Forme juridique :
FCP de droit français

Création du fonds : 02.12.2013

Ticker Bloomberg :
PREDIVR FP

Indice de référence :
EURIBOR 3M capitalisé

Devise de référence : EUR

Durée de placement recommandée : 3 ans

Valorisation : Hebdomadaire

Investissement initial minimum :
1 part

Politique de dividendes :
Capitalisation

Dépositaire / Valorisateur :
CACEIS

Centralisation des ordres : 11h00

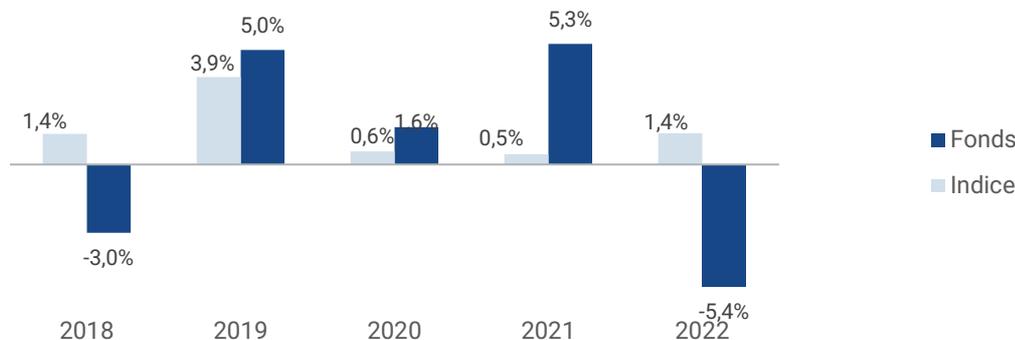
Règlement : J+2

Frais de gestion : 0.60% TTC max

Commission de surperformance :
Néant

Performances

ANNUELLE (%)



Cumulée (%)

	Fonds	Indice
1 mois	-0,3	0,4
3 mois	0,3	1,2
Depuis début de l'année	1,8	2,9
1 an	0,2	3,8
3 ans	4,7	4,9
5 ans	5,8	10,4
Depuis création	14,4	21,9

Annualisée (%)

	Fonds	Indice
3 ans	1,5	1,6
5 ans	1,1	2,0
Depuis la création	1,4	2,1

Indicateurs de risque

	Fonds
Nombre de titres	54
Volatilité 3 ans	3,2%
Ratio de Sharpe 3 ans	0,49

Répartition géographique

En %	Fonds
Europe de l'Ouest	78,4
Amérique du Nord	11,1
Asie Pacifique	1,5
Europe de l'Est	0,2
Amérique du Sud et Centrale	0,0
Afrique et Moyen Orient	0,1
Autres	8,7

Prevaal Diversifié

FR0011521871

Reporting mensuel • 31 août 2023

EQUIPE DE GESTION



Ewen Picaud
Gérant principal



Morgane Monestier
Gérante back-up

10 principales valeurs

Emetteurs	Fonds	Type
Lyxor Euro Gov Bond 1-3Y	5,8%	Obligations souveraines
Lyxor Euro Gov Bond 5-7Y Dr	5,3%	Obligations souveraines
Amundi Etf Govt Bond Euro Br	5,2%	Obligations souveraines
Amundi Eur Corp Ucits Etf Ac	4,7%	Obligations d'entreprises
Lyxor Eur Government Bd 3-5Y	4,6%	Obligations souveraines
Spdr Global Conv Eur-H Acc	4,6%	Obligations convertibles
Amundi Eur Corporate Bond 1-	4,5%	Obligations d'entreprises
Franklin Eur Sh Mt Ucits Etf	4,4%	Obligations d'entreprises
Lyxor Core Eurstx50 Dr	4,3%	Obligations souveraines
Jpm Eur Ultst Inc Ucits Etf	4,1%	Obligations d'entreprises
	47,5%	

Principaux mouvements

↗ Ishares Core Euro Stoxx 50	↘ Rag-Stiftung
↗ -	↘ Deutsche Lufthansa Ag
↗ -	↘ -

Principaux contributeurs

⊕ Ishares Usd Treasury 3-7Yr	⊖ Lyxor Core Eurstx50 Dr
⊕ Amblo-Equal Weight Commexagr	⊖ Lyxor Core Eurstx 600 Dr
⊕ MLFP 0 11/10/23	⊖ Ishares Core Euro Stoxx 50

Composition

En %	Fonds
Obligations investment grade	52,3
Monétaire et équiv.	23,2
Obligations high yield	11,6
Actions	11,2
Liquidités	0,8
Matières premières	0,8

Expositions et caractéristiques

	Fonds
Actions	17,2%
High Yield	11,6%
Maturité moyenne	2,4
Sensibilité taux	2,3
Rendement moyen	3,1%
US dollar	0%

Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures. Les performances sont calculées nettes de frais de gestion. Les OPCVM ne sont pas garantis en capital. Pour plus d'informations, le prospectus, le DIC, les rapports annuels et semestriels sont disponibles sur notre site internet www.prevaalfinance.fr. Ce document est destiné à des clients professionnels. Il ne peut être reproduit, diffusé, communiqué, en tout ou partie, sans autorisation préalable de la société de gestion.

Source : CACEIS, Bloomberg, Prevaal Finance,