

Exane Pleiade Fund

(part B, Euro)

Long/short actions market neutral

Univers : Multi-secteurs

Code ISIN : LU0616900774 | Date de lancement : 30 mai 2011

Gérant : Eric Lauri

CITYWIRE / AAA



Description du fonds

Exane Pleiade vise à réaliser une performance absolue, régulière et peu corrélée avec les classes d'actifs traditionnelles.

Chiffres clés

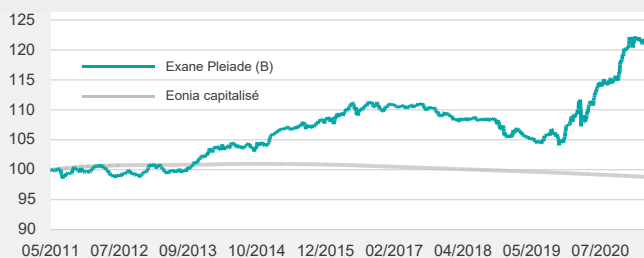
- ▶ Performance mensuelle : **1.46%**
- ▶ 2021 : **2.15%**
- ▶ VL (€) : **122,98**
- ▶ Actif net du fonds (Mio €) : **1324**

Composition du portefeuille

| | LONG | SHORT |
|--------------------|-------------|---------------------|
| Nombre de lignes | 109 | 136 |
| Contribution (bps) | 281 | -130 |
| Top 5 (poids) | | Top 5 (poids) |
| | Sanofi | Novo Nordisk B |
| | Engie | ENI SpA |
| | BP | Snam SpA (Italie) |
| | E.On | Roche Holding AG |
| | AstraZeneca | Abbott Laboratories |

Performances

| | 12 mois | 2 ans | 3 ans | 5 ans | Depuis création |
|----------------------|---------|--------|--------|--------|-----------------|
| Cumulées | | | | | |
| Exane Pleiade (B) | 11.64% | 16.65% | 13.64% | 11.58% | 22.98% |
| Eonia capitalisé (*) | -0.48% | -0.90% | -1.26% | -1.97% | -1.20% |
| Annualisées | | | | | |
| Exane Pleiade (B) | 11.64% | 7.99% | 4.35% | 2.21% | 2.11% |
| Eonia capitalisé (*) | -0.48% | -0.45% | -0.42% | -0.40% | -0.12% |



*Le fonds cherche à restituer une performance absolue, régulière et décorrélée des marchés. L'eonia capitalisé n'est pas l'indicateur de référence du fonds.

Risques

| | 2 ans | Depuis création |
|------------------------------|-------------|-----------------|
| Volatilité | 3.9% | 2.5% |
| Volatilité 12 mois min./max. | 2.1% / 5.0% | 1.2% / 5.0% |
| Ratio de sharpe | 2,1 | 0,9 |

Contributions*/ expositions

| | Exposition brute moyenne | Contribution nette |
|---|--------------------------|--------------------|
| Santé | 38.37% | 0.66% |
| Industries et construction | 28.92% | 0.22% |
| Services aux collectivités | 25.05% | 0.20% |
| Chimie | 12.78% | 0.03% |
| Banques | 9.29% | 0.02% |
| Technologie | 9.27% | -0.07% |
| Distribution | 8.79% | 0.09% |
| Energie | 8.67% | 0.44% |
| Médias | 7.64% | 0.08% |
| Produits de consommation durable | 6.73% | -0.15% |
| Telecoms | 6.36% | 0.13% |
| Sociétés de services personnels et professionnels | 6.21% | -0.07% |
| Assurances | 4.18% | -0.00% |
| Services financiers | 3.95% | 0.01% |
| Immobilier | 3.38% | -0.09% |
| Produits ménagers et personnels | 3.19% | -0.08% |
| Agroalimentaire et boissons | 2.35% | 0.10% |
| Autos et Equipements | 2.01% | -0.01% |
| Ressources de base | 0.04% | -0.00% |
| Total | 187.18% | 1.51% |

| Meilleures contributions | Contribution | Poids moyen |
|------------------------------|--------------|-------------|
| BP PLC | 0.29% | 4.30% |
| DELIVERY HERO SE | 0.25% | 1.62% |
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE | 0.23% | -2.03% |
| LONZA GROUP AG-REG | 0.18% | 2.52% |
| KORIAN | 0.18% | 1.97% |

| Pires contributions | Contribution | Poids moyen |
|-----------------------|--------------|-------------|
| SONOVA HOLDING AG-REG | -0.13% | -2.20% |
| NOVO NORDISK A/S-B | -0.12% | -4.13% |
| KERING | -0.11% | -1.49% |
| BASF SE | -0.10% | 1.99% |
| SIEMENS ENERGY AG | -0.09% | 0.82% |

*Contribution en alpha : contribution relative du titre par rapport à son secteur dans la performance du fonds

| Mouvements acheteurs | |
|------------------------------|-------|
| NOVARTIS AG-REG | 1.97% |
| GEBERIT AG-REG | 1.72% |
| FRESENIUS SE & CO KGAA | 1.42% |
| CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG | 1.39% |
| BANCO SANTANDER SA | 1.25% |

| Mouvements vendeurs | |
|-------------------------------|--------|
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN | -3.49% |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | -2.36% |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | -1.28% |
| AXA SA | -1.22% |
| GN STORE NORD A/S | -1.12% |

| Exposition du fonds | 30 avril 2021 | Moyenne sur 12 mois |
|-------------------------------|---------------|---------------------|
| Long | 98.6% | 91.3% |
| Short | -94.1% | -86.1% |
| Brute | 192.8% | 177.3% |
| Nette/nette ajustée du beta | 4.5% / 7.0% | 5.2% / 7.6% |
| Top 5 des positions à l'achat | 20.9% | 19.6% |

Historique des performances

| | 2021 | 2020 | 2019 | 2018 | 2017 | 2016 | 2015 | 2014 | 2013 | 2012 | 2011 |
|--------------|---------------|----------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|
| Janvier | +0.71% | +1.55% | +0.69% | -0.61% | +0.24% | -0.05% | +1.57% | +0.58% | +1.09% | -0.06% | - |
| Février | +0.60% | +0.34% | +0.25% | -0.27% | -0.19% | +0.47% | +0.43% | +0.66% | -0.57% | +0.84% | - |
| Mars | -0.62% | -0.61% | -0.93% | -0.01% | +0.18% | +0.27% | +0.39% | +0.19% | +0.29% | +0.15% | - |
| Avril | +1.46% | +1.26% | -0.32% | -0.14% | -0.39% | +0.74% | +0.39% | -0.13% | -0.97% | -0.72% | - |
| Mai | - | +0.51% | -0.35% | +0.23% | +0.24% | +0.68% | -0.25% | +0.73% | +0.43% | -0.98% | - |
| Juin | - | +3.03% | -0.19% | -0.26% | +0.13% | -1.20% | +0.01% | -0.70% | -0.05% | -0.06% | -0.10% |
| Juillet | - | +0.38% | +0.11% | +0.11% | +0.16% | +0.36% | +0.93% | +0.02% | -0.28% | +0.08% | 0.00% |
| Août | - | -0.11% | +0.89% | +0.09% | -0.68% | +0.83% | -0.52% | +0.20% | +0.33% | +0.47% | -0.55% |
| Septembre | - | +0.40% | +0.15% | +0.03% | +0.14% | +0.08% | -0.12% | -0.29% | +0.58% | +0.01% | +0.01% |
| Octobre | - | +0.38% | -0.88% | -0.35% | -0.59% | +0.08% | +0.65% | +0.68% | +0.59% | -0.48% | +0.68% |
| Novembre | - | +3.22% | -0.24% | -0.79% | -0.51% | -1.02% | +0.55% | +0.08% | +1.13% | +0.13% | +0.23% |
| Décembre | - | +1.19% | +2.42% | -1.35% | +0.27% | +0.42% | +0.18% | -0.27% | +0.17% | +0.46% | -0.44% |
| Année | +2.15% | +12.06% | +1.58% | -3.27% | -1.00% | +1.65% | +4.27% | +1.76% | +2.76% | -0.17% | -0.17% |

Depuis création

| | |
|-------------------------------------|----------------------|
| % de mois positifs | 63.03% |
| Meilleure performance mensuelle | +3.22% novembre 2020 |
| Plus mauvaise performance mensuelle | -1.35% décembre 2018 |

| | Stoxx 600* | Pleiade (b)* |
|---------------------|------------|--------------|
| Mois en hausse (72) | +2.88% | +0.33% |
| Mois en baisse (48) | -3.17% | -0.05% |

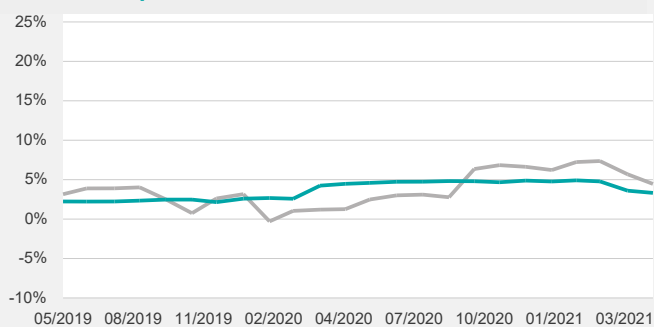
*Performances mensuelles moyennes

Exposition du fonds

(en % de l'actif net)

| | Capitalisation Boursière < 5 Mds € | Capitalisation Boursière > 5 Mds € |
|-------|------------------------------------|------------------------------------|
| Long | 8.2% | 90.4% |
| Short | -3.2% | -90.9% |

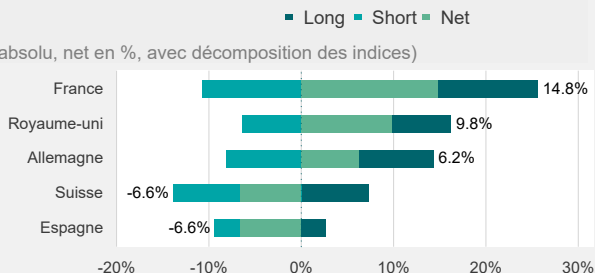
Volatilité et exposition nette du fonds sur 24 mois



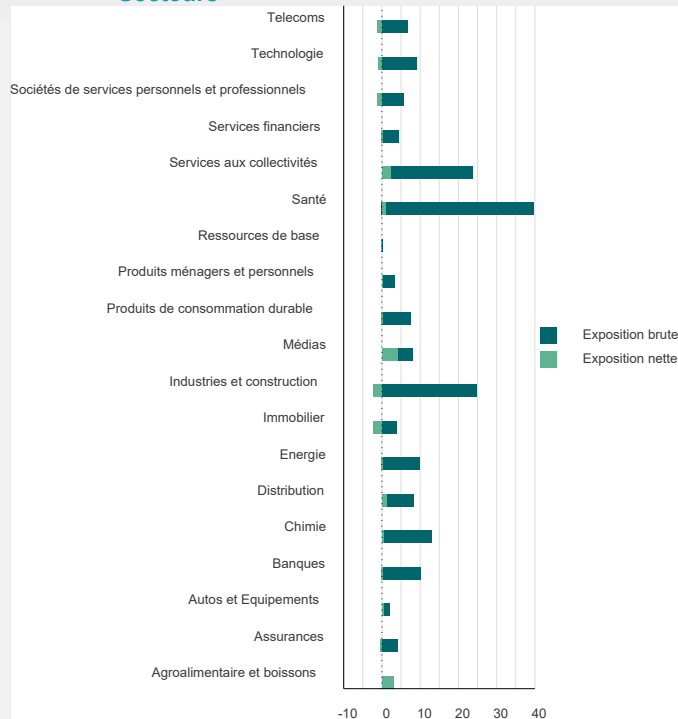
— Volatilité 12 mois
— Exposition nette

Pays

(top 5 en absolu, net en %, avec décomposition des indices)



Secteurs



Pour plus d'informations : www.exane-am.com

Avertissement : les performances passées ne préjugent pas des performances futures. Tout investissement peut générer des pertes ou des gains. Le présent document informatif ne constitue pas le prospectus de la SICAV et ne doit pas être considéré comme une offre commerciale, une sollicitation d'investissement ou le support d'un conseil en investissement. Toute souscription dans la SICAV ne peut être réalisée que sur la base du prospectus. L'investisseur est invité à se reporter à la rubrique facteurs de risques du prospectus. Exane cristal fund est immatriculé au Luxembourg et enregistré pour la commercialisation en Espagne, Italie, Belgique et Allemagne.