



## Chiffres Clés

Valeur liquidative Part I : 1 115.07€

Actif net Part I : 75.58M€

Actif net fonds : 282.60M€

## Horizon de placement

1 ans	2 ans	3 ans	4 ans	5 ans
-------	-------	-------	-------	-------

## Profil de risque et de rendement

1	2	3	4	5	6	7
---	---	---	---	---	---	---

## Caractéristiques

**Forme juridique** : Compartiment de la SICAV de droit luxembourgeois La Française AM Fund

**Type de part** : Part I

**Date de création** : 21/02/2014

**Indice de référence** : Barclays Capital Euro Government Inflation Linked Bond Index

**Affectation des résultats** : Capitalisation

**Fréquence de valorisation** : Quotidienne

**Devise de référence** : Euro

**Cliantèle** : Investisseurs institutionnels

**Risques supportés** : taux, inflation, discrétionnaire, arbitrage, crédit, change, contrepartie, perte en capital

**Fourchette de sensibilité** : entre 0 et 10

## Informations Commerciales

**Code ISIN** : LU0970531975

**Code Bloomberg** : LFPEIC LX Equity

**Droits d'entrée max** : 3.0%

**Droits de sortie max** : Néant

**Frais de gestion max** : 0.68%

**Frais de gestion variables** : 20% TTC de la performance au-delà de l'indice Barclays Capital Euro Government Inflation Linked Bond Index-Plafonnée à 2.5% de l'actif net

**Centralisation des ordres** : J avant 11H

**Règlement** : J+2

**Souscription initiale min.** : 100 000 €

**Dépositaire** : BPSS Luxembourg

**Valorisateur** : BPSS Luxembourg

**Société de gestion** : La Française AM International

**Gestionnaire financier par délégation** : La Française Asset Management

**Gérant** : François COLLET

**Commercialisateur** : La Française AM

Document à destination des non professionnels et professionnels au sens de la MIF - Document non contractuel - Avant toute souscription, prenez connaissance du prospectus disponible sur internet : [www.lafrancaise-group.com](http://www.lafrancaise-group.com)  
Sources : La Française Asset management, données comptables, Bloomberg

## Stratégie d'investissement

L'objectif du Compartiment est de générer une performance tout au long de la période d'investissement recommandée de plus de trois ans, nette de frais et supérieure à celle de l'indice Barclays Capital Euro Government Inflation-Linked Bond (indice BEIG1T).

## Performances nettes en EUR

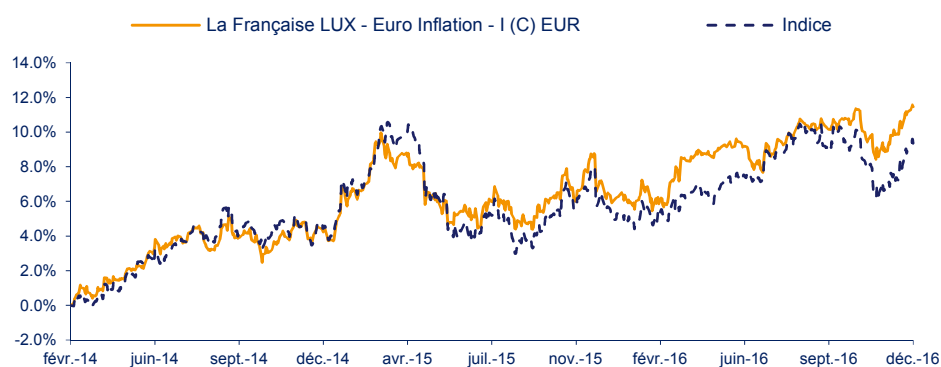
Les performances passées ne préjugent pas des performances futures et ne sont pas constantes dans le temps

Cumulées	1 mois	3 mois	2016	1 an	3 ans	5 ans	Création*
Fonds	1.89%	0.72%	4.88%	4.88%	-	-	11.46%
Indice de référence	2.02%	-0.93%	3.79%	3.79%	-	-	9.29%

Annualisées	1 an	3 ans	5 ans	Création*
Fonds	4.88%	-	-	3.87%
Indice de référence	3.79%	-	-	3.16%

\* Création le 21/02/14

## Evolution de la performance nette depuis la création



## Indicateurs de risque

Sensibilité taux	4.49		
Fréquence hebdo	1 an	3 ans	5 ans
Volatilité Fonds	3.77%	-	-
Volatilité indice	4.43%	-	-
Ratio de sharpe	1.38	-	-

\* sur les titres en portefeuille

## Analyse des rendements

	Depuis la création
Gain maximum	11.57% (du 21/02/14 au 29/12/16)
Max. Drawdown	-5.09% (du 12/03/15 au 16/09/15)
Recouvrement	324 jours (le 05/08/16)
Meilleur mois	2.62% (mars-16)
Moins bon mois	-2.11% (déc-15)
% Mois >0	65.71%
% Mois surperf.	57.14%

## Historique des performances nettes mensuelles en %

		Janv	Févr.	Mars	Avr.	Mai	Juin	Juil.	Août	Sept.	Oct.	Nov.	Déc.	Année
2016	Fonds	0.90	-1.33	2.62	0.26	0.49	-0.36	0.88	0.33	0.32	-0.61	-0.55	1.89	4.88
	Indice	0.68	-0.86	1.36	-0.14	0.94	1.28	1.08	-0.16	0.51	-1.80	-1.12	2.02	3.79
2015	Fonds	1.77	1.95	0.00	-0.09	-1.82	-0.48	1.22	-1.93	0.68	1.62	1.24	-2.11	1.95
	Indice	2.41	0.87	1.19	-0.39	-2.15	-1.87	1.65	-2.29	0.60	2.24	1.12	-2.38	0.82
2014	Fonds		0.60	0.34	0.90	1.26	0.79	0.50	0.16	-0.30	-0.61	0.90	-0.36	4.24
	Indice		0.26	0.42	0.94	1.15	0.76	0.80	1.15	-0.62	-0.22	0.33	-0.56	4.44



## Structure du Portefeuille

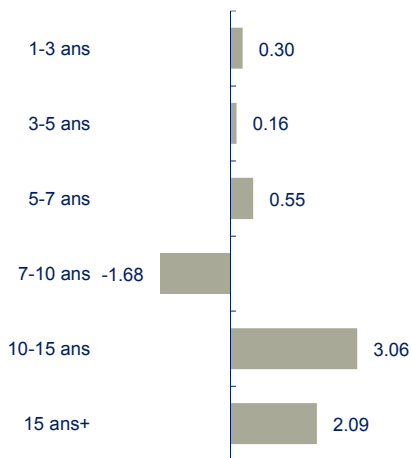
En % actif net



- Obligations indexées : 98.89%
- OPCVM monétaires : 3.96%
- Liquidités : 1.39%
- Obligations taux fixe : -4.24%

## Sensibilité par maturité

Contribution à la sensibilité



## Répartition par type d'indexation

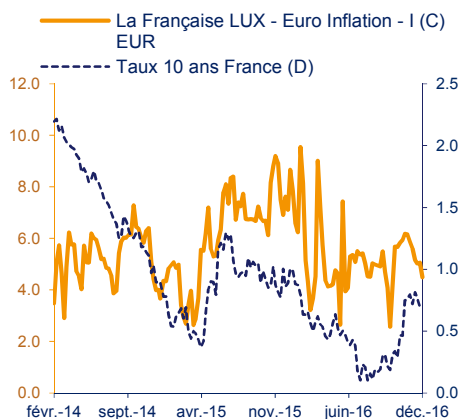
En % actif net

Type d'indexation

<b>Zone Euro</b>	<b>94.20%</b>
Core Euro	44.82%
Périphériques	49.38%
<b>Etats-Unis</b>	<b>4.70%</b>
<b>Autres</b>	<b>0.00%</b>
<b>Total</b>	<b>98.89%</b>

## Evolution de la sensibilité taux

Sensibilité du fonds : 4.49



## Principaux émetteurs

Libellé	Secteur	Note*	Contrib. Sensi	% actif
Etat Italien	Etat Zone Euro	BBB	2.73	42.60%
Etat Français	Etat Zone Euro	AA	2.22	27.92%
Etat Allemand	Etat Zone Euro	AAA	2.56	16.90%
Etat Espagnol	Etat Zone Euro	BBB	0.88	6.77%

\*correspond au rating le plus récent entre S&P et Moody's