

VALMY ACTIONS MONDE

REPORTING

Communication
Publicitaire

31/05/2024

ACTIONS

PERFORMANCE DEPUIS LE LANCEMENT (Source : Fund Admin)



LES PERFORMANCES PASSÉES NE REFLÈTENT PAS LES PERFORMANCES FUTURES

PERFORMANCES DU FONDS (Source : Fund Admin)

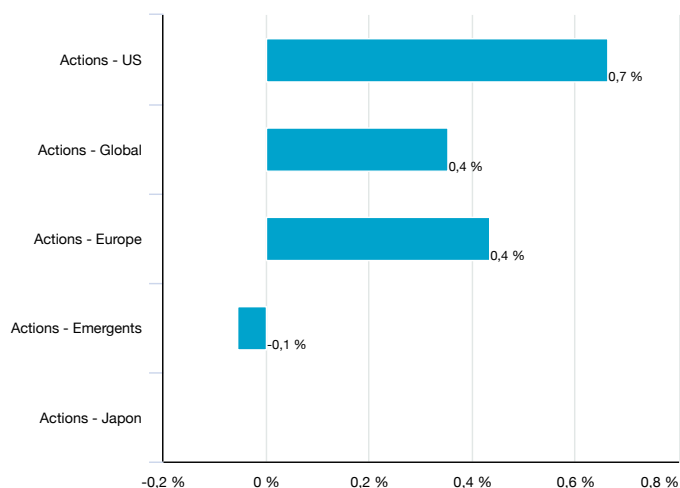
-	MTD	YTD	3 mois	6 mois	1 an	2 ans	Depuis le lancement
VALMY ACTIONS MONDE	1,22%	9,70%	2,95%	13,53%	18,16%	21,07%	59,40%
MSCI WORLD NR Close	2,89%	11,44%	3,49%	15,48%	22,68%	25,82%	93,75%

PERFORMANCES MENSUELLES* (Source : Fund Admin)

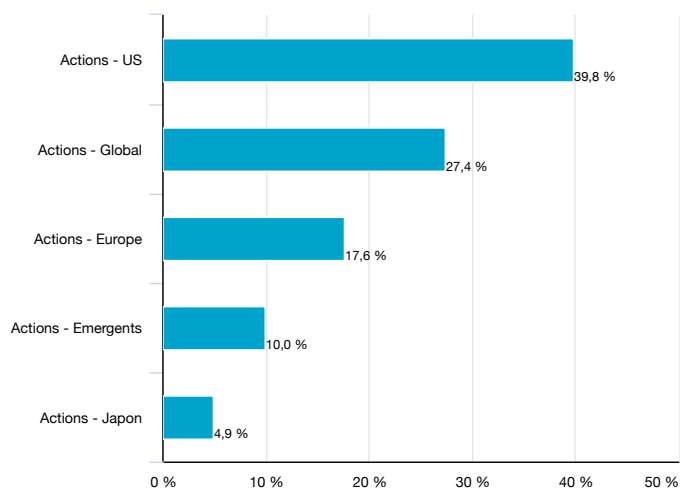
	Jan	Fev	Mar	Avr	Mai	Juin	Jui	Aou	Sep	Oct	Nov	Dec	AN
2018	-	-	-	-	0,10%	-1,71%	2,60%	1,09%	0,53%	-6,40%	2,01%	-7,41%	-9,32%
2019	6,78%	4,23%	1,67%	4,53%	-5,25%	3,54%	3,16%	-2,53%	2,37%	0,85%	3,90%	1,16%	26,61%
2020	1,34%	-8,97%	-12,88%	9,99%	2,04%	1,78%	0,54%	4,37%	-1,81%	-2,58%	10,03%	1,66%	3,09%
2021	0,50%	2,72%	4,82%	2,20%	0,61%	3,59%	1,13%	3,09%	-2,62%	4,81%	0,00%	3,50%	26,94%
2022	-5,92%	-4,28%	2,75%	-3,20%	-2,16%	-6,68%	9,25%	-2,73%	-7,42%	4,67%	2,68%	-5,54%	-18,33%
2023	6,37%	1,07%	-0,52%	0,08%	2,72%	2,80%	1,84%	-1,01%	-2,13%	-3,91%	6,78%	3,49%	18,42%
2024	3,36%	3,10%	3,35%	-1,59%	1,22%	-	-	-	-	-	-	-	9,70%

*Depuis le lancement : 07/03/2018

CONTRIBUTION À LA PERF. (Source : Amundi)



ALLOCATION PAR CLASSE D'ACTIF



POINTS CLÉS

Actif Net du Fonds	80,46 (millions EUR)
VL de la classe	162,83 EUR
1 mois	1,22%
Depuis le lancement	59,40%
YTD	9,70%
Volatilité Annualisée	15,29%
Ratio de Sharpe	0,49
Perte Maximale*	-32,40%

CARACTERISTIQUES DU FONDS



Laurent Hoffmann

Gérant de portefeuille

Type de fonds

Structure Juridique	FCP Français
Date de Lancement du Fonds	07/03/2018
Date de Lancement de la Classe	07/03/2018
Devise de Référence	EUR
Société de Gestion	Amundi Asset Management
Dépositaire	SOCIETE GENERALE

Codes du fonds

Code ISIN	FR0013296076
Code Bloomberg	-

VALMY ACTIONS MONDE

REPORTING

Communication
Publicitaire

31/05/2024

ACTIONS ■

STATISTIQUES (Source : Fund Admin)*

	Portefeuille		Indice	
	Depuis le lancement	1 an	Depuis le lancement	1 an
Performance Mensuelle Moyenne	0,74%	1,44%	1,03%	1,76%
Meilleur mois	11/2020	11/2023	11/2020	11/2023
Meilleure performance	10,03%	6,78%	11,12%	5,96%
Moins bon mois	03/2020	10/2023	03/2020	10/2023
Moins bonne performance	-12,88%	-3,91%	-13,14%	-2,74%
% Des mois Positifs	68,06%	66,67%	63,89%	66,67%
% des mois négatifs	31,94%	33,33%	36,11%	33,33%
Gain Mensuel Moyen	3,12%	3,24%	3,60%	3,66%
Perte Mensuelle Moyenne	-4,31%	-2,16%	-3,51%	-2,05%
Perte Maximale*	-32,40%	-7,55%	-33,76%	-7,53%
Temps de Récupération (Jours)	304	35		

5 POSITIONS PRINCIPALES

	Code ISIN	Stratégie	Sous-Stratégies	Allocation Actuelle	Perf. MTD****	Contribution mensuelle
Allianz Global Sustainability - P - Eur	LU1405890390	Actions - Global	Global	19,94%	0,71%	0,15%
Allianz Best Styles Us Equity - IT- Eur	LU1311290925	Actions - US	US	19,93%	2,03%	0,38%
ALM ACTIONS EUROPE ISR-IC	FR0007494703	Actions - Europe	unknown	12,53%	2,17%	0,28%
FEDERIS ISR ACTIONS US I	FR0013277522	Actions - US	US	12,44%	1,78%	0,22%
Fidelity Funds - Emerging Market - Y - Acc - Eur	LU1097728361	Actions - Emergents	EM	9,97%	-0,70%	-0,06%

5 PRINCIPAUX CONTRIBUTEURS

	Code ISIN	Stratégie	Sous-Stratégies	Allocation Actuelle	Perf. MTD****	Contribution mensuelle
Allianz Best Styles Us Equity - IT- Eur	LU1311290925	Actions - US	US	19,93%	2,03%	0,38%
ALM ACTIONS EUROPE ISR-IC	FR0007494703	Actions - Europe	unknown	12,53%	2,17%	0,28%
FEDERIS ISR ACTIONS US I	FR0013277522	Actions - US	US	12,44%	1,78%	0,22%
AMUNDI MSCI WORLD EX EUROPE UC ETF EUR	LU1681045537	Actions - Global	Global	7,45%	2,82%	0,21%
A-F EURO EQUITY ESG IMPROVERS I	LU2151177073	Actions - Europe	Europe	5,03%	3,04%	0,15%

COMPOSITION DU PORTEFEUILLE

	Code ISIN	Stratégie	Sous-Stratégies	Allocation Actuelle	Perf. MTD****	Contribution mensuelle
Actions - US	-	-	-	39,82%	1,67%	0,66%
Allianz Best Styles Us Equity - IT- Eur	LU1311290925	Actions - US	US	19,93%	2,03%	0,38%
FEDERIS ISR ACTIONS US I	FR0013277522	Actions - US	US	12,44%	1,78%	0,22%
AMUNDI S&P500 Clim N Z Amb PAB ETF Ac (P	IE000O5FBC47	Actions - US	unknown	7,46%	0,83%	0,06%
Actions - Global	-	-	Global	27,39%	1,29%	0,35%
Allianz Global Sustainability - P - Eur	LU1405890390	Actions - Global	Global	19,94%	0,71%	0,15%
AMUNDI MSCI WORLD EX EUROPE UC ETF EUR	LU1681045537	Actions - Global	Global	7,45%	2,82%	0,21%
Actions - Europe	-	-	-	17,56%	2,47%	0,43%
ALM ACTIONS EUROPE ISR-IC	FR0007494703	Actions - Europe	unknown	12,53%	2,17%	0,28%
A-F EURO EQUITY ESG IMPROVERS I	LU2151177073	Actions - Europe	Europe	5,03%	3,04%	0,15%
Actions - Emergents	LU1097728361	-	EM	9,97%	-0,70%	-0,06%
Fidelity Funds - Emerging Market - Y - Acc - Eur	LU1097728361	Actions - Emergents	EM	9,97%	-0,70%	-0,06%
Actions - Japon	LU1681037609	-	unknown	4,92%	-0,29%	-0,01%
AMND TOPIX DV ETF(PAR)	LU1681037609	Actions - Japon	unknown	4,92%	-0,29%	-0,01%

****Les performances sont calculées en devise du portefeuille

Positions en Portefeuille

9

GLOSSAIRE

Alpha : Mesure du rendement excédentaire d'un actif par rapport à un indice de référence.

Beta : Mesure de la volatilité d'un actif par rapport à la volatilité d'un indice de référence. Un beta supérieur à 1 traduit une volatilité supérieure à celle de l'indice de référence et un beta inférieur à 1 exprime une volatilité inférieure.

Ratio de Calmar : Ratio qui désigne la performance annuelle d'un actif sur une période donnée divisée par le Maximum Drawdown (perte maximale historique) de cet actif sur ladite période.

Corrélation : Mesure statistique du degré de relation entre les mouvements de deux variables données. Le coefficient de corrélation utilisé ici s'étend de -100% à +100%, +100% représentant la corrélation positive parfaite.

Delta : Mesure de la relation entre le prix d'une option et le prix du contrat ou du titre sous-jacent.

Volatilité négative : Mesure de la variabilité / dispersion entre le positionnement d'une série de valeurs et un « rendement minimum acceptable » (MAR), par l'examen des seuls points inférieurs au MAR.

Drawdown : Mesure, à un moment donné, de la performance du fonds par rapport à son niveau maximum.

High-Water Mark : Niveau record, en termes de valeur, atteint par un compte/fonds d'investissement. Le High-Water mark est habituellement utilisé, le cas échéant, pour déterminer la Commission de performance.

MAR : Rendement minimum acceptable (Minimum Acceptable Return), comme indiqué dans le présent rapport.

VaR mensuelle modifiée : Mesure de la perte maximale qui serait encourue par un investisseur, dans des conditions normales de marché, sur une période prédéterminée (un mois dans le cas présent), sur la base d'un niveau de confiance prédéterminé (inférieur à 95% des scénarios statistiques dans le cas présent).

Margin to Equity mensuel : Mesure de l'appel de marge initial de chaque classe d'actifs par rapport à l'Actif Net du Fonds. L'appel de marge initial est défini par le Prime Broker, lequel utilise un système de calcul des risques appelé SPAN (Standard Portfolio Analysis of Risk).

Accumulation (run-up) : Performance totale du fonds, à un moment donné, pour chacun des mois consécutifs précédents pendant lesquels le fonds a affiché un rendement mensuel positif. Elle équivaut à zéro lorsque le fonds a produit un rendement négatif le mois précédent.

Ratio de Sharpe : Mesure du rendement ajusté du risque d'un actif, lequel équivaut à son rendement sur une période donnée moins le taux sans risque, divisé par sa volatilité.

Ratio de Sortino : Mesure du rendement ajusté du risque d'un actif, lequel équivaut à son rendement sur une période donnée, après déduction du « rendement minimum acceptable » (MAR), divisé par la volatilité des rendements de l'actif inférieurs au MAR sur cette période.

Ecart type : Mesure de la variabilité (dispersion) d'une série de valeurs. Un écart type peu élevé indique que tous les points sont proches de la moyenne, tandis qu'un écart type élevé indique une « dispersion » sur un large éventail de valeurs.

Volatilité : Mesure de la taille et de l'amplitude des variations de la valeur d'un actif.

INFORMATIONS IMPORTANTES POUR LES INVESTISSEURS

Aucune divulgation, reproduction ou utilisation extérieure autorisée :

Ce document a été préparé uniquement pour les personnes à qui il a été distribué directement par Amundi AM ou l'un de ses affiliés ou délégués. Son contenu ne peut être divulgué, reproduit ou utilisé ou invoqué par toute autre personne, ou utilisé à toute autre fin.