



GEFIP INVEST-RENDEMENT

Fiche mensuelle / Octobre 2020

CHIFFRES CLES AU 30/10/2020

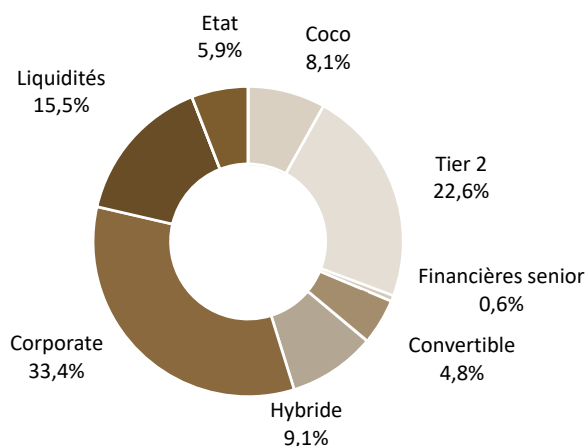
| | |
|-------------------------|---------|
| Valorisation Action I : | 996,13€ |
| Valorisation Action P : | 98,49€ |
| Actif Net : | 43,3 M€ |

NOTATION ETHIQUE (Trimestrielle)

Notation du risque ESG par GEFIP (données Sustainalytics) : 25,9 (note trimestrielle)

| | | | | |
|------------|---------|-------------|---------|----------|
| Inexistant | Faible | Raisonnable | Fort | Sévère |
| (0-10) | (10-20) | (20-30) | (30-40) | (40-100) |

VENTILATION PAR TYPE DE DETTE



ANALYSE DU PORTEFEUILLE

| | |
|----------------------------|--------|
| Rendement moyen (au Call) | 1,6% |
| Sensibilité taux | 0,5% |
| Maturité moyenne (au Call) | 0,6 an |
| Notation moyenne | BBB- |
| Nombre de valeurs | 40 |
| Couverture crédit | 0% |
| Volatilité annualisée | 3,4% |

PRINCIPALES LIGNES

| | |
|--|------|
| INFLATION ITALIE 3,75% 01/2021 | 5,9% |
| VOLKSWAGEN 3,75% PERP – Call 03/2021 | 3,6% |
| FIAT CHRYSLER 4,75% 03/2021 | 3,4% |
| ORANO 3,5% 03/2021 | 3,1% |
| CREDIT AGRICOLE 6,5% PERP – Call 06/2021 | 3,1% |
| FORD MOTOR FRN 12/2021 | 2,9% |
| BARCLAYS 2,625% 2025 – Call 11/2020 | 2,9% |
| FAURECIA 2,625% 06/2025 | 2,8% |
| TELEFONICA 3,75% PERP – Call 03/2022 | 2,6% |
| RENAULT 3,125% 03/2021 | 2,6% |

PERFORMANCES

PERFORMANCES MENSUELLES ACTION I

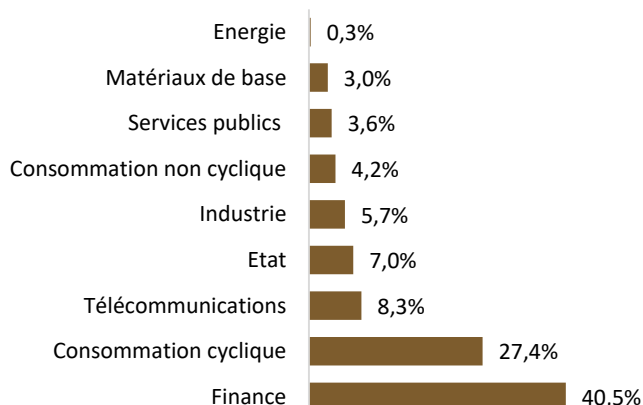
| Année | Janv. | Fév. | Mars | Avril | Mai | Juin | Juil. | Août | Sept. | Oct. | Nov. | Déc. | Annuelle |
|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|----------|
| 2016 | | | | | | -1,1% | 1,2% | 0,4% | -0,4% | 0,4% | -0,5% | 0,8% | 0,8% |
| 2017 | 0,5% | 0,3% | 0,1% | 0,5% | 0,3% | 0,1% | 0,4% | 0,0% | 0,3% | 0,5% | 0,0% | 0,1% | 3,0% |
| 2018 | 0,3% | -0,3% | -0,4% | 0,2% | -1,4% | -1,0% | 0,8% | -0,7% | 0,5% | -0,7% | -0,9% | -0,2% | -3,7% |
| 2019 | 0,9% | 0,4% | 0,1% | 0,4% | -0,3% | 0,4% | 0,2% | 0,1% | -0,1% | 0,0% | 0,1% | 0,2% | 2,3% |
| 2020 | 0,0% | -0,9% | -6,9% | 2,8% | 1,0% | 0,5% | 0,5% | 0,4% | 0,0% | 0,0% | | | -2,7% |

PERFORMANCES CUMULEES

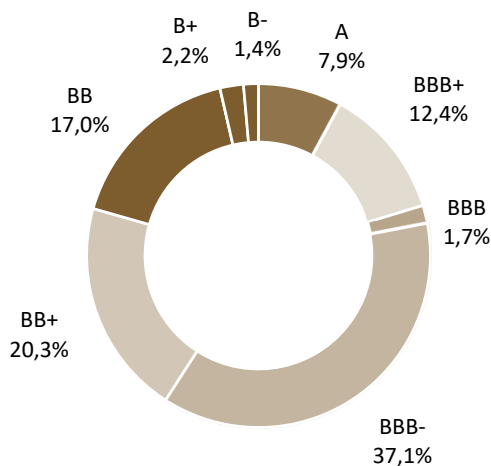
| Période | 1 an | 3 ans | Depuis l'origine |
|-----------------------|-------|-------|------------------|
| ACTION I | -2,4% | -4,0% | -0,4% |
| ACTION P | -2,7% | -4,7% | -1,5% |
| EURIBOR 3 mois + 1,5% | 1,1% | 3,4% | 5,2% |

ALLOCATION DU PORTEFEUILLE (hors liquidités & dérivés)

SECTEURS



NOTATION



PRINCIPAUX MOUVEMENTS

ACHATS

INFLATION ITALIE 3,75% 01/2021

COMMERZBANK 7,75% 03/2021

ORANO 3,5% 03/2021

CARREFOUR 3.875% 04/2021

VENTES OU REMBOURSEMENTS

ARKEMA 4,75% PERP – Call 10/2020

AIR FRANCE 6,25% PERP – Call 10/2020

RWE 2,75% PERP – Call 10/2020

UNICREDIT 5,75% 10/2025 – Call 10/2020

BFCM 4% 10/2020

ORIENTATION DU COMPARTIMENT

GEFIP Invest-Rendement est un fonds obligataire euro. Son objectif est d'offrir une performance nette de frais de gestion supérieure de 150 points de base par rapport au taux Euribor 3 mois ; en investissant dans des obligations à taux fixe et/ou variable libellées en euro, et dont la maturité maximum est de 4 ans à échéance ou au call. Le fonds investit sur des obligations Investment Grade et Haut Rendement, de notation minimum B-.

CARACTERISTIQUES DU COMPARTIMENT

| | |
|-----------------------------|---|
| Date de création : | 03/06/2016 |
| Code ISIN : | Action I : LU1362345875 Action P : LU1362345289 |
| Allocation d'actifs : | Obligations |
| Objectif : | Euribor 3 mois + 150 bps |
| Affectation des résultats : | Capitalisation |
| Forme Juridique : | Compartiment de la SICAV Luxembourgeoise GEFIP INVEST Autorisé à la commercialisation en France et en Belgique, UCITS V Non enregistré SEC et non accessible à US Person |
| Société de gestion : | GEFIP 20, rue Quentin Bauchart 75008 PARIS Tel : 01 42 96 57 37 Fax : 01 42 61 22 51 Mail : info@gefip.fr Agrément AMF : GP90043 |

TARIFICATION ET ORGANISATION

| | |
|-------------------------------|--|
| Frais de gestion financière : | Action I : 0,4% TTC (Souscription minimum 100 000 €) Action P : 0,6% TTC |
| Droit d'entrée : | 0% |
| Droit de sortie : | 0% |
| Commission de performance : | Action I : 15% de la performance au-dessus de Euribor 3 mois +150 bps Action P : 20% de la performance au-dessus de Euribor 3 mois +150 bps |
| Valorisation : | Quotidienne |
| Valeur liquidative : | Valorisation au cours de clôture au Bid |
| Dépositaire : | BNP Paribas Securities Services Luxembourg |
| Comptable : | BNP Paribas Securities Services Luxembourg |
| Commissaire aux comptes : | Mazars Luxembourg |