La Française Carbon Impact Floating Rates TC

Registrado en: FR DE IT CH FI ES NL

CIFRAS CLAVE

VL : 116,83€
Activo neto del fondo : 440,99M€

PERFIL DE RIESGO Y DE REMUNERACIÓN

1 2 3 4 5 6 7

Riesgo menor — Riesgo mayor

Rentabilidad potencialmente menor — Rentabilidad potencialmente mayor

disclaimer_scale_risk

HORIZONTE DE INVERSIÓN

1 año	>2 años	3 años	4 años	5 años

CARACTERÍSTICAS

Forma jurídica : Fondo de la SICAV de derecho francés LA FRANCAISE
Clasificación de la AMF : Renta fija internacional
Fecha de creación : 25/02/2021
Objetivo del fondo : Euribo 3 meses + 150bp
Asignación de sumas distribuibles : Capitalización
Divisa : EUR
Frecuencia de valoración : Diaria
Clientes : Todos los suscriptores
Principales riesgos incurridos : cambio de divisas, cocos, convertibles, crédito, default, derivados, discrecional, pérdida de capital, especulativo, subordinados, tipos de interés

INFORMACIÓN COMERCIAL

Código ISIN : FR0013481785
Código Bloomberg : LAIFRTE FP Equity
Centralización : D antes de las 11H
Fecha de Liquidación : D+2 días hábiles
Elegibilidad para el PEA : No
Comisión de suscripción máx. : 3%
Comisión de reembolso máx. : 0%
frais_gestion_max : frais_gestion_max_1056802
Gastos corrientes : 0.48%
Depositario : custodian_bnp_paribas_sa
Administrador : fund_admin_bnp_paribas_s_a
Sociedad gestora : management_company_credit_mutuel_asset_management
Gestores : managers_jeremie_boudinet_aurore_le_crom_emma_gayrard
MS_overall_rating : ★★★★★

changement_strat_276

ESTRATEGIA DE INVERSIÓN

orientation_276

RENTABILIDADES NETAS

Las cifras mostradas corresponden a rentabilidades pasadas, no son garantía de rentabilidades futuras y no son constantes a lo largo del tiempo. Estas rentabilidades no tienen en cuenta las comisiones y gastos relacionados con la suscripción y reembolso de participaciones.

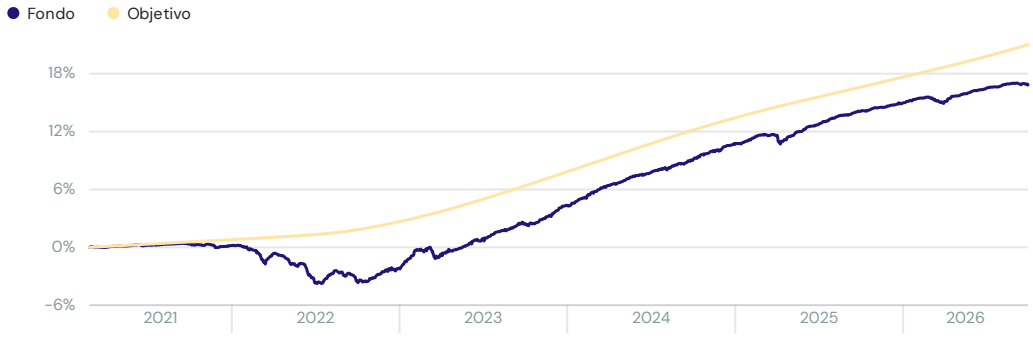
Acumuladas	MTD	3 meses	YTD	1 año	3 años	5 años	Creación
Fondo	-0,16%	0,33%	1,63%	2,40%	14,06%	16,43%	16,83%
Objetivo	0,34%	1,01%	2,85%	3,76%	13,77%	20,31%	20,99%

Anualizadas	3 años	5 años	Creación
Fondo	4,47%	3,09%	2,82%
Objetivo	4,39%	3,77%	3,46%

HISTÓRICO DE RENTABILIDADES MENSUALES

		Ene.	Feb.	Mar.	Abr.	Mayo	Junio	Julio	Agosto	Sept.	Oct.	Nov.	Dic.	Año
2026	Fondo	0,37%	0,14%	-0,52%	0,64%	0,39%	0,27%	0,21%	0,28%	-0,16%				-
	Objetivo	0,29%	0,27%	0,31%	0,30%	0,29%	0,33%	0,33%	0,34%	0,34%				-
2025	Fondo	0,45%	0,44%	-0,10%	-0,08%	0,70%	0,41%	0,63%	0,28%	0,32%	0,34%	0,15%	0,27%	**3,88%**
	Objetivo	0,36%	0,31%	0,33%	0,31%	0,29%	0,29%	0,30%	0,28%	0,31%	0,30%	0,27%	0,32%	**3,73%**
2024	Fondo	0,64%	0,70%	0,60%	0,39%	0,59%	0,23%	0,51%	0,41%	0,29%	0,65%	0,26%	0,61%	**6,05%**
	Objetivo	0,49%	0,43%	0,41%	0,49%	0,45%	0,40%	0,47%	0,41%	0,42%	0,39%	0,36%	0,38%	**5,21%**
2023	Fondo	1,37%	0,64%	-0,54%	0,44%	0,55%	0,63%	0,68%	0,41%	0,42%	0,21%	0,86%	0,80%	**6,66%**
	Objetivo	0,34%	0,32%	0,37%	0,36%	0,44%	0,41%	0,44%	0,45%	0,43%	0,48%	0,45%	0,43%	**5,01%**
2022	Fondo	-0,20%	-0,58%	-0,11%	-0,45%	-0,58%	-1,93%	0,70%	0,15%	-0,70%	0,22%	0,81%	0,34%	**-2,35%**
	Objetivo	0,08%	0,07%	0,08%	0,08%	0,10%	0,10%	0,12%	0,17%	0,20%	0,25%	0,27%	0,29%	**1,84%**

EVOLUCIÓN DE LA RENTABILIDAD DESDE LA CREACIÓN



INDICADORES DE RENTABILIDAD

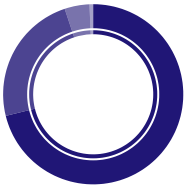
	1 año	3 años	5 años
Volatilidad del fondo	0,57%	0,76%	1,31%
Ratio de Sharpe	0,66	2,18	0,74

	Desde la creación
Plusvalía máxima	21,58%
Pérdida máx.	-4,18%
Recuperación	335 días (el 06/06/2023)

La Française Carbon Impact Floating Rates TC

TIPO DE ACTIVO

En % del activo neto



Bonos tipo variable	71,14%
Bonos tipo fijo	23,72%
Fondos monetarios	4,47%
Liquidez	0,67%

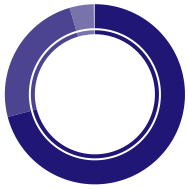
ESTRATEGIA

En % de la renta fija

strat_obl_3_credit_ig_eur	49,42%
Crédito IG EE.UU.	23,53%
strat_obl_3_credit_hy_eu	9,08%
strat_obl_3_subordonnee	8,23%
strat_obl_3_subordonnee	6,18%
strat_obl_3_credit_ig_aut	1,24%
Crédito HY EE.UU.	0,80%
Crédito Emergente	0,79%
Gobierno Periférico Zona Euro	0,74%

DIVISA

En % de la renta fija



EUR	70,95%
USD	24,50%
AUD	4,32%
GBP	0,12%
SEK	0,11%

PAÍS

En % de la renta fija

EE.UU.	19,43%
Francia	12,75%
Reino Unido	12,00%
Alemania	10,28%
Italia	6,98%
Canadá	5,48%
Países Bajos	5,34%
España	4,39%
Japón	4,09%
Australia	3,46%
Otros	15,77%

INDICADORES DE RIESGO

Duración	0,34	Vencimiento medio al 1er call (años)	2,22
Sensibilidad de crédito	2,66	Rating medio de las emisiones	BBB
Yield To Maturity (YTM)	4,26%	Rating medio de los emisores	BBB+
ytw_portfolio	4,02%	Cupón medio	4,26%
discount_margin_portfolio	128	% bonos calleables	61,44%
Coste de la cobertura de divisas	-0,36%		

La tasa de rentabilidad publicada a) no constituye una promesa de rentabilidad; b) es susceptible de cambiar con el tiempo dependiendo de las condiciones del mercado; c) es la media ponderada de la rentabilidad de los valores de la cartera denominados en moneda local; d) no tiene en cuenta los impagos que puedan surgir; e) rendimiento instantáneo bruto sin tener en cuenta los costes de cobertura.
El coste de la cobertura de divisas es una estimación del coste de cobertura durante un año.

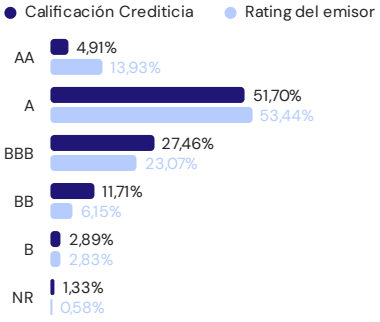
SECTORES DE BONOS

En % de la renta fija

Financieros	67,03%
Consumo Cíclico	9,53%
Consumo no cíclico	9,33%
Comunicaciones	5,08%
Industriales	3,19%
Tecnología	2,05%
Servicios públicos	1,55%
Materias primas	1,01%
Estado	0,74%
Gobiernos	0,49%

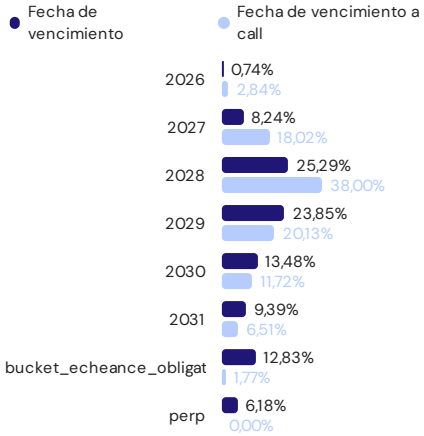
RATINGS

En % de la renta fija



MATURITY_COMPARAISON

En % de la renta fija



PRINCIPALES EMISORES

Excluyendo liquidez

Nombre	País	Sectores de bonos	Rating del emisor	Peso
Goldman Sachs Group Inc	EE.UU.	Financieros	A	2,23%
HSBC Holdings plc	Reino Unido	Financieros	A-	2,22%
emetteur_barclays_plc	Reino Unido	Financieros	BBB+	1,87%
Intesa Sanpaolo Spa	Italia	Financieros	A-	1,68%
BNP Paribas	Francia	Financieros	A+	1,67%
Citigroup Inc	EE.UU.	Financieros	A-	1,60%
Ubs Group Ag	Suiza	Financieros	A	1,54%
emetteur_lloyds_banking_group_plc	Reino Unido	Financieros	A-	1,51%
emetteur_morgan_stanley	EE.UU.	Financieros	A-	1,39%
emetteur_banque_federative_du_credit_mutuel	Francia	Financieros	A+	1,37%

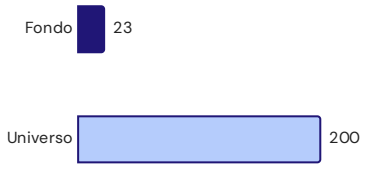
Número de emisores: 205 **Peso de las 10 primeros emisores:** 17,09%

La Française Carbon Impact Floating Rates TC

univers_definition: undefined

INTENSIDAD CARBONO

toneladas de CO2 equiv. / M€ invertidos



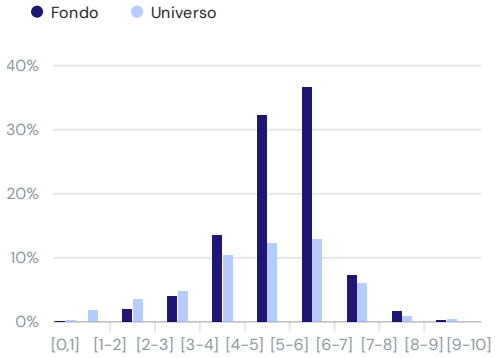
PUNTUACIÓN IMPACTO CARBONO

subtitle_carbon_coverage

	Fondo	benchmark_esg
Cobertura impacto carbono	98,02%	76,09%
Puntuación impacto carbono	5,79	5,22

CARBON_DISTRIBUTION

subtitle_distribution_carbon



CARBON_FOOTPRINT_BY_SECTOR

carbon_footprint_by_sector_subtitle

sectors	weight_pct	Huella de carbono	carbon_footprint_universe_diff
Materias primas	0,96%	2	-7
Consumo Cíclico	9,04%	2	-3
Consumo no cíclico	8,86%	1	-1
Servicios públicos	1,47%	1	-9
Financieros	63,59%	0	0
Comunicaciones	4,82%	0	0
Industriales	3,03%	0	-5
Tecnología	1,94%	0	0
Energia	0,00%	0	-7
Other	6,30%	1	1
Total		**7**	**-31**

TOP5_CARBON

subtitle_main_lines_carbon

issuer	Peso	Puntuación impacto carbono
	0,23%	9,23
	0,25%	8,89
EDF	0,81%	8,49
Koninklijke Kpn Nv	0,19%	8,43
	0,23%	8,20

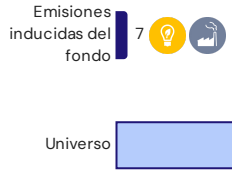
WORST5_CARBON

subtitle_main_lines_carbon

issuer	Peso	Puntuación impacto carbono
ROSSINI SARL	0,07%	1,00
	0,80%	2,46
	0,33%	2,46
	0,86%	2,62
	0,32%	3,17

HUELLA DE CARBONO

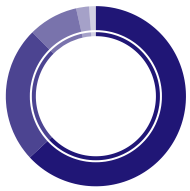
toneladas de CO2 equiv. / M€ invertidos



Reducción de la huella de carbono con respecto al benchmark	91%

THEME_BREAKDOWN

theme_breakdown_subtitle



ci_category_credit_low_carbon	59,86%
ci_category_credit_transition_aligned	23,19%
ci_category_credit_transition_ambitions	8,47%
ci_category_credit__n_a	2,19%
ci_category_credit_winners	1,17%

MAIN_GREEN_BONDS

Emisor	weight_fund_pct	Puntuación impacto carbono
Unicredit Spa	0,17%	6,01
Volvo Car Ab	0,17%	6,96
Telefonica Europe BV	0,17%	7,50
	0,14%	6,50
	0,07%	6,82

Green Bonds:	0,76%

La Française Carbon Impact Floating Rates TC

univers_definition: undefined

DATOS SOBRE EL IMPACTO

data_impact_subtitle

Huella de carbono
91%
lower
7 tco2m vs 86.526 tco2m*

energy_savings
2 000
homes_over_1y

20 000
trees_to_be_planted
290 000 invested_in_universe

3 400
avoided_cars_over_1y

680 000
recycled_garbage_bags

DEFINICIONES DE TÉRMINOS EXTRAFINANCIEROS

Puntuación Impacto de Carbono : El puntaje de Impacto de Carbono soberano se calcula como el promedio del puntaje de Adaptación y el puntaje de Transición para cada país. El proceso de Impacto de Carbono Soberano consiste en una exclusión del 20% de los Estados con calificaciones más bajas de acuerdo con la siguiente distribución: 10% de los Estados cuyas calificaciones de Adaptación son las más bajas en el universo de inversión inicial y 10% de los Estados cuyas calificaciones de Transición son el más bajo del universo de inversión inicial.

Intensidad de carbono: La intensidad de carbono de un país se calcula como la relación entre el volumen de emisiones de gases de efecto invernadero (GEI) del país en toneladas de CO2eq y el PIB. La intensidad de carbono de una empresa se calcula como la relación entre el volumen de emisiones de gases de efecto invernadero (GEI) de la empresa en toneladas de CO2eq y las ventas.

Huella de Carbono: indicador de las emisiones de CO2 generadas por las compañías de nuestra cartera (en toneladas de CO2 por millón de euros invertidos). El modelo de cálculo de CO2 es proporcionado por La Française, basándose principalmente en los datos proporcionados por la CDP. Cubre los alcances 1 y 2. El cálculo es el siguiente: Σ (i a n) (Inversión i) / (Capitalización del mercado del emisor i) × Emisiones del emisor i

Bonos verdes: Un bono verde es emitido por una compañía con el fin de financiar o refinanciar proyectos con un impacto ambiental positivo de acuerdo con la taxonomía de los "Principios de los Bonos Verdes".

Bajo en carbono: Esta clasificación es el resultado de un análisis de carbono patentado. Si una compañía pertenece a esta categoría, significa que su trayectoria de intensidad de carbono está muy por debajo de los 2 °C de la trayectoria de referencia (o incluso de 1.5°C) de su sector.

def_extrafi_credit_transition_aligned

Ambiciones requeridas: Esta clasificación es el resultado de un análisis de carbono patentado. Si una compañía pertenece a esta categoría significa que está haciendo esfuerzos por reducir las emisiones de CO2 , pero su trayectoria de intensidad de carbono no está todavía alineada o por debajo de los 2 °C de referencia de su sector

La Française Carbon Impact Floating Rates TC

ADVERTENCIAS

disclaimer_new_cmam

Clasificación SFDR : El Reglamento SFDR (Sustainable Finance Disclosure Regulation) tiene como objetivo dirigir los flujos de capital hacia inversiones más responsables, para garantizar la transparencia, coherencia y calidad de la información para los inversores y, por lo tanto, permitir una comparación de los diferentes vehículos de inversión.
Se aplica a todos los agentes del mercado financiero pero también a los productos.
3 categorías de productos:
1/ Automáticamente todos los fondos se clasifican en el artículo 6, sin objetivo de sostenibilidad.
2/ Luego viene el artículo 8 para los fondos que promueven Características ASG.
3/ El artículo 9 va más allá, con un objetivo de inversión sostenible y medible. Es decir, los fondos invierten en una actividad que contribuya a un objetivo ambiental o social, como reducir las emisiones de CO2 o combatir la desigualdad.

disclaimer_sfdr_complement

Gestor: Equipo de gestión actual, susceptible de cambiar con el tiempo.

Calificación de emisión: corresponde a la calificación de emisión más reciente entre S&P y Moody's, de lo contrario del emissor.
Calificación del emisor: corresponde a la calificación del emisor más reciente entre S&P y Moody's
La sociedad de gestión no utiliza exclusiva ni mecánicamente las calificaciones establecidas por las agencias de calificación y realiza su propio análisis crediticio. Las calificaciones se determinan caso por caso sobre la base de una metodología interna y están sujetas a cambios.

DEFINICIONES

def_sri

Volatilidad: medida de la variación de la rentabilidad del fondo durante un periodo determinado. Cuanto mayor sea, más volátil será, y por tanto mayor será su riesgo.

Ratio Sharpe: mide la rentabilidad del que se beneficia el fondo para cada punto de volatilidad asumido en relación con un activo denominado sin riesgo.

Max.Drawdown: pérdida máxima histórica en la que habría incurrido un inversor que invirtiera al máximo y saliera al mínimo.

Recuperación: tiempo necesario para recuperar la pérdida máxima.

Duración: permite medir la variación porcentual, al alza o a la baja, del precio de un bono o del valor liquidativo de un OICVM de renta fija, inducida por una fluctuación del 1% de de los tipos de interés del mercado.

def_spread_modified_duration

def_discount_margin