

Profil de risque



Statistiques mensuelles

2,69%	-4,78%	12,50%	59,32%
Sur un mois	En 2022	Volatilité 52 semaines	Note ESG

Profil de gestion

Ce fonds ou ce mandat, reflète la gestion moderne adaptée aux conditions fluctuantes des marchés en travaillant sur les marchés actions et dérivés sur des unités de temps beaucoup plus courtes. (scalp, swing, etc...) en plus d'une partie stratégique investie sur des valeurs sélectionnées de type « Pépites ».

Le contrôle des risques y est primordial en travaillant fondamentalement avec plus d'une cinquantaine d'algorithmes sur-mesure qui surveillent le comportement du marché et des investisseurs (notamment la force relative en sus de l'analyse des flux et techniques graphiques classiques).

L'un de ses objectifs est d'écarter arbitrairement la gestion indicielle (OPC, ETF,..) qui ne regarde pas les sous-jacents et qui investit également sur des valeurs « Zombies ».

Ce fonds ou ce mandat est une véritable gestion "PURE" ISR et ESG dans le cadre réglementé de l'article 9. (SFDR)

Notre équipe le considère comme reflétant une gestion de performance éthique, responsable et ultra réactive sans effet de levier.

Commentaire de gestion

Au niveau du marché des actions, l'invasion de l'Ukraine par la Russie fait ressurgir le risque de guerre sur le continent européen après plus de 70 années d'accalmie. Ainsi, l'ensemble des indices actions européens cassent leur tendance haussière initiée après le premier confinement du au Covid-19.

Concernant les taux, malgré ses « bruits de bottes » les banques centrales vont être contraintes de relever leur taux d'intérêt directeur au vu de l'emballement des prix des matières premières qui risquent d'impacter lourdement la croissance économique et de nous amener à une situation de « stagflation » ; phénomène que nous mettons en garde depuis un certain temps chez Blue Colibri.

A propos des matières premières, la Russie étant l'un des principaux producteurs de pétrole, gaz, palladium, nickel, blé, aluminium et acier au monde, autant dire que les sanctions économiques dévoilées par les pays occidentaux ont littéralement fait s'envoler les cours des commodités précédemment citées. Chez Blue Colibri, nous rappelons que nous demeurons extrêmement prudents sur les sociétés européennes gourmandes en matières premières dont les marges risquent fort de s'étioler ; et ce d'autant plus avec la faiblesse de l'euro face au dollar.

En ce qui concerne les devises justement, l'euro perd de la valeur face à l'ensemble des grandes devises internationales avec comme exemples emblématiques, un retour à la parité face au franc suisse, ou encore un plus bas niveau face à la Livre sterling depuis l'annonce du Brexit.

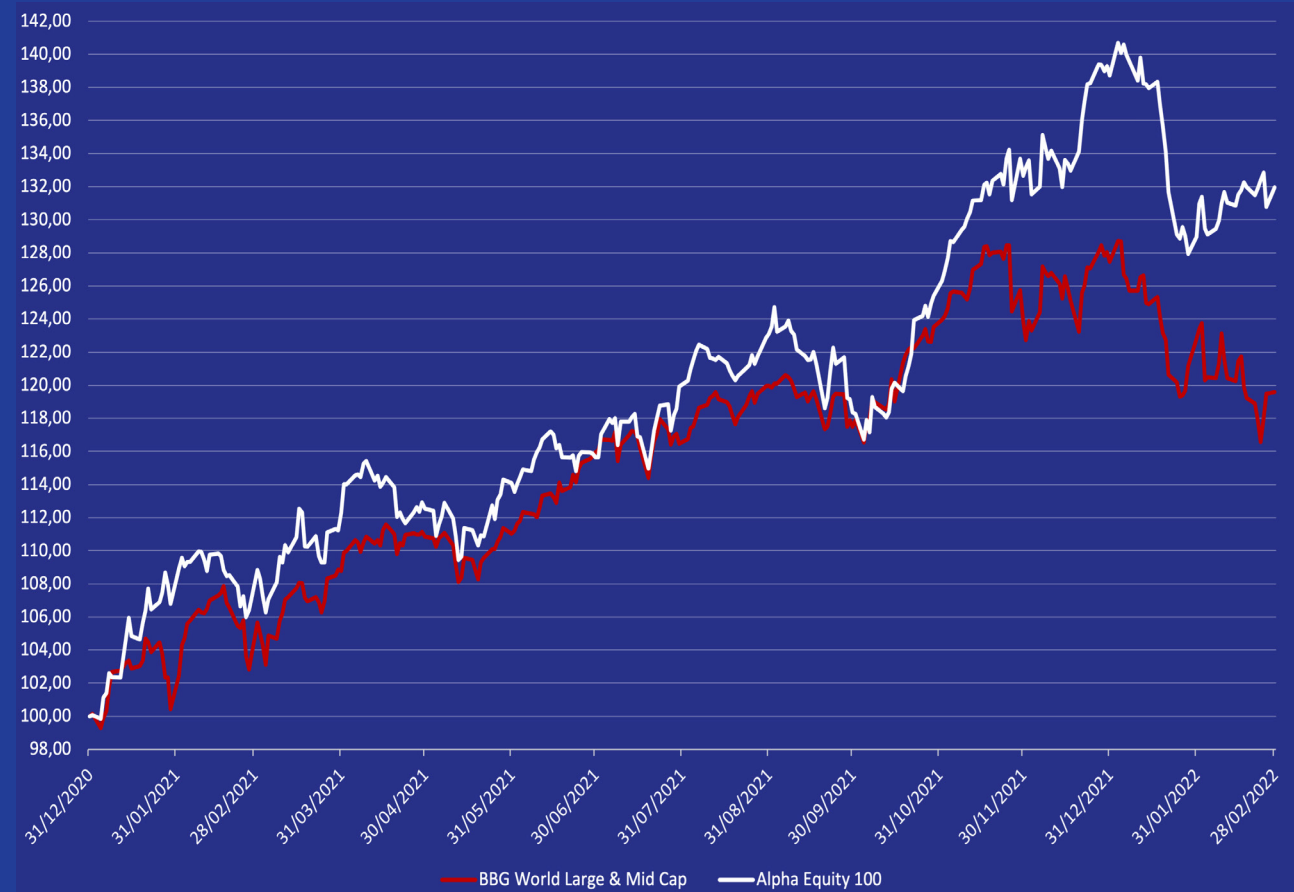
Enfin, au niveau géopolitique, Poutine est finalement passé à l'acte à peine les Jeux Olympiques en Chine cloturés. L'Europe est une nouvelle fois la principale victime de ce conflit qui risque fort d'entraîner de lourdes répercussions sur l'approvisionnement en matières premières tant le Vieux Continent est dépendant des ressources russes.

STATISTIQUES FINANCIÈRES

	Alpha Equity 100	BBG World Large & Mid Cap
Performance YTD	-4,78%	-6,18%
Performance 1 mois	2,69%	-1,33%
Performance 3 mois	0,57%	-3,92%
Performance 6 mois	8,14%	0,08%
Performance 52 semaines	23,72%	16,29%
Volatilité sur 52 semaines	12,50	11,55
Nombre de lignes	36	>3500

	Alpha Equity 100
Beta	0,74
Ratio de sharpe	2,04
Poids des 5 principales lignes	43,04%
Poids des 10 principales lignes	58,57%

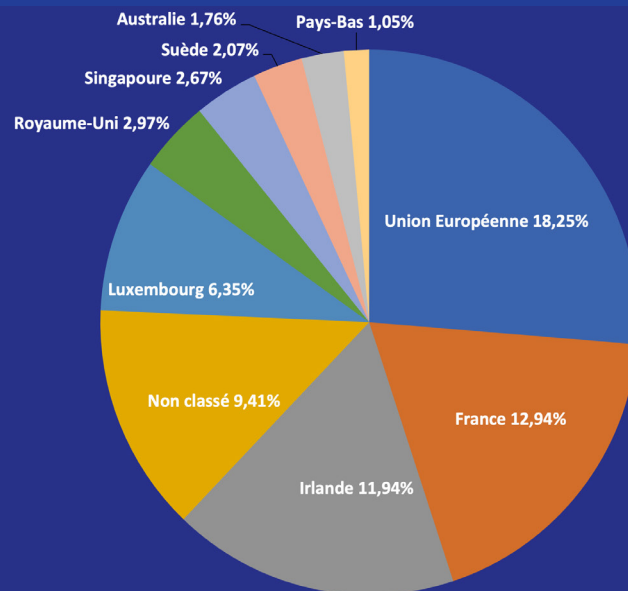
Alpha Equity 100 vs Bloomberg World Large & Mid Cap



Période du 31/12/2020 au 28/02/2022

RÉPARTITION DE ALPHA EQUITY 100

Répartition géographique



Répartition par type d'actifs

ACTIONS	46,38%
FONDS	31,75%
DEVICES	18,25%
OBLIGATIONS	3,62%
DÉRIVÉS	-73,60%

Répartition par devises

DEVISE	RÉPARTITION
Euro	31,81%
Couronne suédoise	2,07%
Dollar US	-7,47%

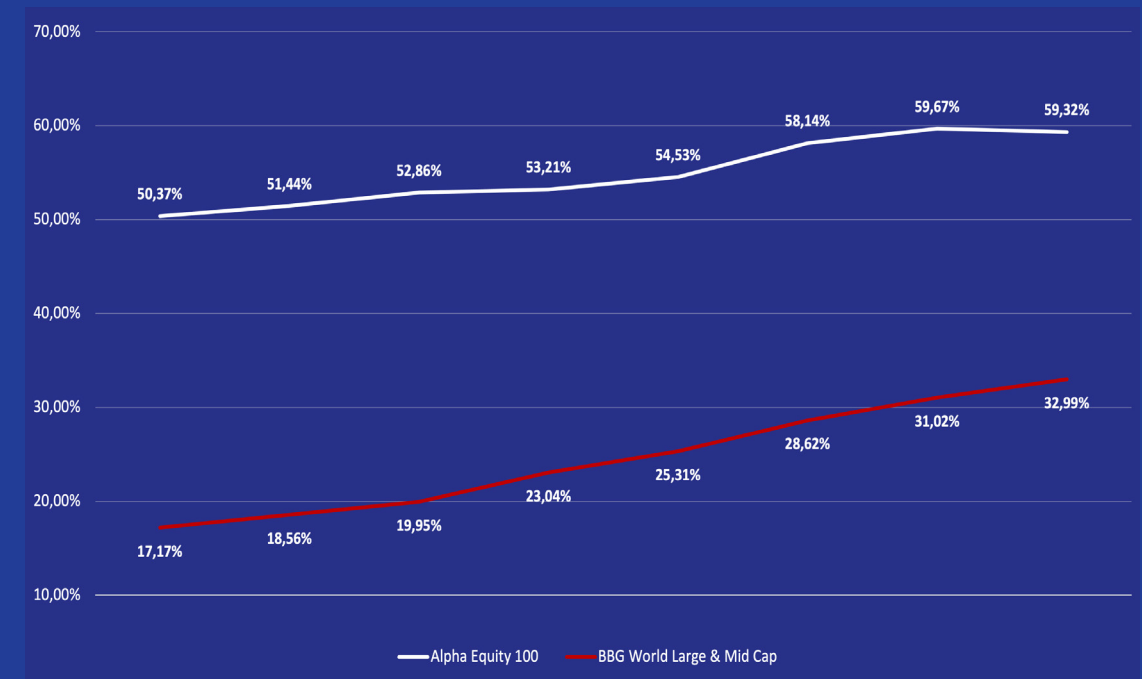
STATISTIQUES EXTRA-FINANCIÈRES

	Alpha Equity 100	Bloomberg World Large & Mid Cap
Note ESG	59,32%	32,99%
Environnement	57,76%	20,94%
Social	59,09%	44,81%
Gouvernance	63,57%	48,82%

Notation de chaque titre

CLASSEMENT	LIBELLÉ	E	S	G	ESG
1	FORD MOTOR CO	89,39%	71,46%	100,00%	86,13%
2	ASML HOLDING NV	79,21%	100,00%	72,49%	84,10%
3	NVIDIA CORP	86,17%	82,64%	77,84%	83,45%
4	RIO TINTO PLC-SPON ADR	76,60%	77,92%	95,72%	80,82%
5	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	89,18%	63,34%	61,92%	75,98%
6	STMICROELECTRONICS NV	68,67%	92,23%	64,65%	74,93%
7	INTEL CORP	58,85%	84,43%	91,61%	73,08%
8	APPLE INC	100,00%	31,61%	57,47%	70,98%
9	LIBERTY GLOBAL	58,99%	72,17%	93,96%	69,94%
10	CISCO SYSTEMS INC	74,80%	60,79%	68,21%	69,28%
11	PEPSICO INC	68,70%	56,77%	85,25%	68,43%
12	MICRON TECHNOLOGY INC	40,62%	100,00%	78,26%	65,96%
13	AMAZON.COM INC	55,45%	70,36%	33,04%	55,44%
14	TELEPERFORMANCE	28,58%	57,76%	75,51%	46,72%
15	BETSSON AB-B	46,23%	37,75%	54,27%	45,29%
16	GROUPE LDLC	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
16	PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
16	S.O.I.T.E.C.	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
16	VALNEVA SE	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%

Trajectoire ESG sur 8 ans



La trajectoire ESG sur 8 ans s'effectue sur un calcul des notes de chaque actions comparé à leur secteur d'activité.

MÉTHODOLOGIE DE NOTATION ESG ET RÉGLEMENTATION

NOTATION ESG VIA L'EXPLOITATION DE BIG DATA

MÉTHODE DE NOTATION DE BLUE COLIBRI AM

Environnement	50%
Social	30%
Gouvernance	20%

BIG DATA

Sélection de **750 à 1 500 champs ESG** sur toutes les sociétés cotées alors que la réglementation n'en impose qu'une trentaine.

MÉTRIQUES ADAPTÉES

180 métriques ESG sélectionnés sur les axes Environnement, Social et Gouvernance pour couvrir tous les secteurs d'activités avec une **surpondération de 50 % sur l'Environnement** sur la notation ESG.

NOTES ESG

Transparence de la notation
Notations sur 8 ans de tous les champs
Univers de sociétés très large (Bloomberg World Large & Mid Cap)

RÉGLEMENTATION

ENTITÉ(*)

Article 3

Politique générale sur les risques de durabilité

Informations à publier sur le site internet

Article 4

Politique générale sur les incidences négatives

Informations à publier sur le site internet

PRODUIT(**)

Article 6

Estimation de l'impact sur le rendement du produit

Article 8

Caractéristiques E et/ou S

Article 11

Incidence globale du produit sur les facteurs de durabilité

Article 11

Estimation du respect des caractéristiques E ou S

Article 5 & 6

Part des investissements dans des activités durables

(*) tous les acteurs financiers sont concernés : sociétés de gestion, CGP, CIF, Banques privées, ...

(**) tous les produits financiers sont concernés : mandat de gestion, OPCVM, contrats d'assurance vie, PEA, PEE, PER, ...

Plus d'informations sur <https://blue-colibri-am.com>

INFORMATION IMPORTANTE

Magestionprivee.com SAS, décline toute responsabilité dans l'utilisation qui pourrait être faite des informations qu'elle diffuse et des conséquences qui pourraient en découler, notamment de toute décision prise sur la base des informations contenues sur le Site ou de nos envois d'informations et reporting, y compris en cas d'erreur ou d'omission. Les informations, graphiques et chiffres sont issus de Bloomberg. Nos opinions ou commentaires rédigés par les équipes de rédaction de Magestionprivee.com SAS ou mis à disposition par cette dernière s'adressent à des investisseurs disposant des connaissances et expériences nécessaires pour comprendre et apprécier les informations qui y sont développées. Ces dernières sont diffusées à titre purement indicatif. Magestionprivee.com SAS ne peut en garantir l'exactitude ou la fiabilité. Magestionprivee.com est agréée ORIAS : 20 003 601 – AMF CIF : E009421