

# Diamant Bleu Intraday C

FR0013192457

Reporting mensuel - 31 décembre 2018

**Valeur liquidative**

975.60€

**Horizon de placement recommandé** (en années)

1

2

3

4

5

**SRI** indicateur de niveau de risque et de rendement du fonds

1

2

3

4

5

6

7

## Stratégie d'investissement

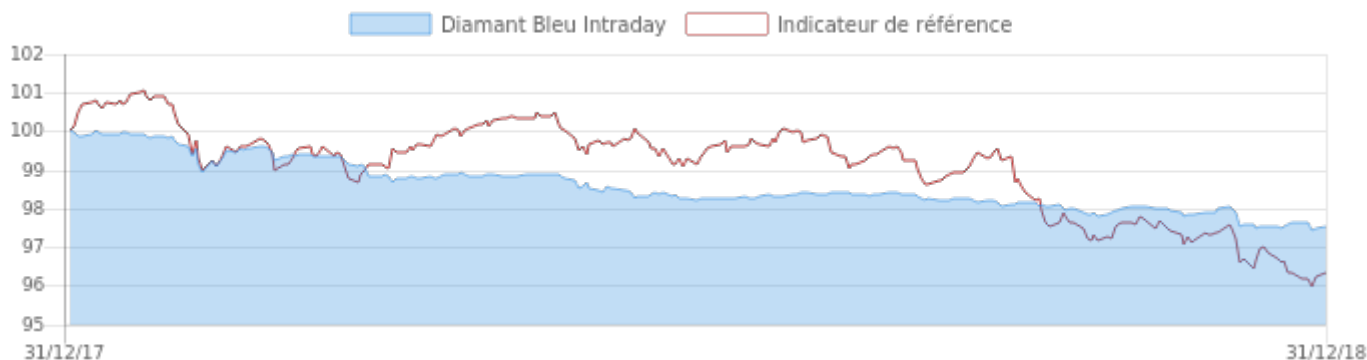
L'objectif est d'obtenir une performance absolue décorrélée des marchés actions avec un risque limité. Cette performance est obtenue via du trading intraday sur futures Euro Stoxx 50. Le fonds est LCR compliant avec un placement du cash visant à maximiser son impact LCR.

## Performances nettes en EUR

Les performances passées ne préjugent pas des performances futures et ne sont pas constantes dans le temps. Ces performances ne tiennent pas compte des commissions et frais liés aux émissions et rachats de parts.

Cumulées	1 mois	3 mois	2018	1 an	création (*)
<b>Fonds</b>	<b>-0.47%</b>	<b>-0.56%</b>	<b>-2.49%</b>	<b>-2.49%</b>	<b>-2.44%</b>
Indicateur de référence	-1.06%	-2.93%	-3.75%	-3.75%	-2.85%
Annualisées				1 an	création (*)
<b>Fonds</b>				<b>-2.49%</b>	<b>-1.33%</b>
Indicateur de référence				-3.75%	-1.56%

## Evolution de la performance sur 1 an glissant



## Statistiques du PTF

Nombre de lignes en portefeuille	18
Poids des 5 premiers lignes	37.17%
Poids des 10 premiers lignes	66.52%
Poids des 20 premiers lignes	97.59%
Poids moyen des lignes en ptf	5.42%

## Principales lignes

Libellé	Secteur	% actif
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT	Government	9.20%
Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG	Financial	8.10%
CIF Euromortgage SA	Financial	7.00%
Credit Mutuel - CIC Home Loan SFH SA	Financial	6.70%
Societe Generale SFH SA	Financial	6.20%

Document non contractuel à destination des non professionnels et professionnels au sens de la directive MIF. Avant toute souscription, consultez notre site [diamantbleugestion.com](http://diamantbleugestion.com)

SAS Diamant Bleu Gestion  
Société par Actions Simplifiée au capital de 250 000€  
514 728 575 RCS PARIS  
Agréée par l'AMF sous le n° GP 09000009  
63 Avenue des Champs-Élysées 75008 Paris, France  
+33(0)1 55 27 27 88 - <http://www.diamantbleugestion.com>  
Une société du Groupe La Française - [www.lafrancaise-group.com](http://www.lafrancaise-group.com)

(\*) 27 février 2017

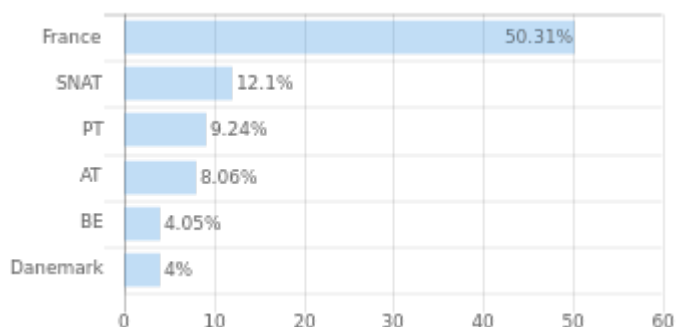


# Diamant Bleu Intraday C

FR0013192457

Reporting mensuel - 31 décembre 2018

## Répartition par pays ( hors OPC )

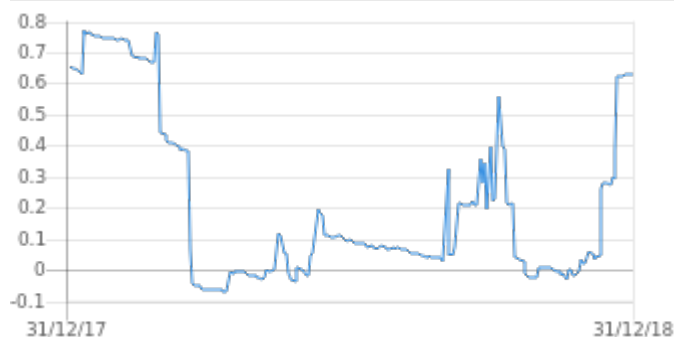


## Attribution de performances ( en bp )

	1 mois
Obligations	10
Couverture obligataire	5
Diversifiés	-1
Trading intraday	-42
Divers	-20
total	-47

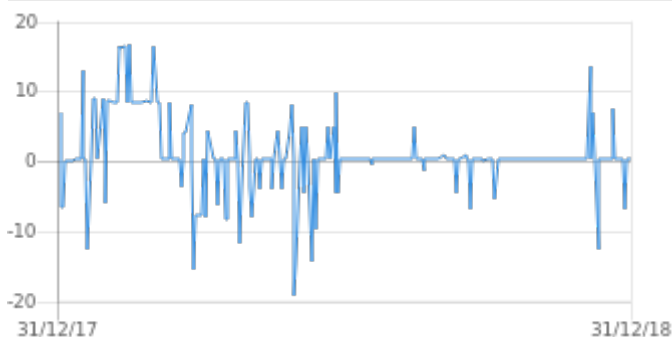
## Sensibilité taux

0.63% au 31/12/18



## Exposition action

0.22% au 31/12/18



## Indicateurs de risque

	1 an	3 ans	5 ans
Fréquence quotidienne			
Volatilité	1.12%		
Ratio de Sharpe	-1.89		
Rating interne moyen			AA-
Maturité moyenne			2.81
Var 95% hebdo			0.12%

Ratio de Sharpe : ratio mesurant la performance dont le fonds bénéficie pour chaque point de volatilité pris par rapport à un actif dit sans risque

## Structure du portefeuille et impact LCR

		haircut	
Souverains	41.3%	0%	41.3%
Covered Bonds	46.5%	7%	43.2%
Corporates Bonds	0%	15%	0%
OPC	9.8%	100%	0%
Cash	2.4%	100%	0%
Total fonds	100%	5%	80.3%

## Caractéristiques du portefeuille

**Actif net part** : 25 M€

**Actif net fonds** : 25 M€

**Forme juridique**: FCP

**Classification AMF**: Obligations et autres titres de créance de la Zone Euro

**Date de création**: 27/02/2017

**Indicateur de référence**: 80% EONIA capitalisé + 20% Euro Stoxx 50 PR

**Affectation des résultats**: Capitalisation

**Fréquence de valorisation**: Quotidienne

**Devise**: Euro

**Clièntèle**: Tous souscripteurs

**Risques supportés**: Perte de capital, taux, crédit, actions, contrepartie, risque lié à la gestion et à l'allocation d'actifs discrétionnaires

**Droits d'entrée max**: néant

**Droit de sortie max**: néant

**Frais de gestion fixes**: 0.30% TTC

**Frais de gestion variables**: 20% TTC au-delà de l'indicateur de référence avec High Water Mark

**Code ISIN**: FR0013192457

**Code Bloomberg**: DBINTRA FP Equity

**Centralisation des ordres**: J avant 14h auprès de BP2S

**Règlement**: J+2

**Dépositaire**: BNP Paribas Securities Services

**Valorisateur**: BNP Paribas Securities Services

**Société de gestion**: Diamant Bleu Gestion

**Gérant**: Chrisitan Jimenez

**Commercialisateur**: Diamant Bleu Gestion

Document non contractuel à destination des non professionnels et professionnels au sens de la directive MIF. Avant toute souscription, consultez notre site [diamantbleugestion.com](http://diamantbleugestion.com)

SAS Diamant Bleu Gestion  
Société par Actions Simplifiée au capital de 250 000€  
514 728 575 RCS PARIS  
Agréée par l'AMF sous le n° GP 09000009  
63 Avenue des Champs-Élysées 75008 Paris, France  
+33(0)1 55 27 27 88 - <http://www.diamantbleugestion.com>  
Une société du Groupe La Française - [www.lafrancaise-group.com](http://www.lafrancaise-group.com)

(\*) High Water Mark : En cas de sous-performance éventuelle, les frais de gestion variables ultérieurs ne sont pas prélevés tant que la sous-performance n'a pas été recouvrée.

