

CARACTERISTIQUES (Source : Groupe Amundi)

Date création : 29/08/2014
Forme juridique : SICAV de droit luxembourgeois
Directive : UCITS IV
Classification AMF : Diversifié
Indice Reference : 100% ESTR CAPITALISE (OIS)
Eligible au PEA : Non
Devise : EUR
Affectation des sommes distribuables :
 Capitalisation
Code ISIN : LU1103787930
Code Bloomberg : CPRRIC LX
Durée minimum de placement recommandé :
 > à 4 ans

Indicateur de risque (Source : Fund Admin)



Risque le plus faible

Risque le plus élevé

L'indicateur de risque part de l'hypothèse que vous gardez le produit pendant > à 4 ans.
 L'indicateur synthétique de risque permet d'apprécier le niveau de risque de ce produit par rapport à d'autres. Il indique la probabilité que ce produit enregistre des pertes en cas de mouvements sur les marchés ou d'une impossibilité de notre part de vous payer.

CHIFFRES CLES (Source : Groupe Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : 153 367,38 (EUR)
Actif géré : 63,25 (millions EUR)
Derniers coupons versés : -

ACTEURS (Source : Groupe Amundi)

Société de gestion : CPR ASSET MANAGEMENT
Dépositaire / Valorisateur :
 CACEIS Bank, Luxembourg Branch / CACEIS Fund
 Administration Luxembourg

MODALITES DE FONCTIONNEMENT (Source : Groupe Amundi)

Fréquence de valorisation : Quotidienne
Heure limite d'ordre : 09:00
VL d'exécution : J
Date de valeur souscription / Date de valeur rachat :
 J+2 / J+2
Minimum 1ère souscription : 100000 Euros
Minimum souscription suivante :
 1 dix-millième part(s)/action(s)
Frais d'entrée (max) / Frais de sortie (max) :
 5,00% / 0,00%
Frais de gestion et autres coûts administratifs ou d'exploitation :
 1,52%
Commission de surperformance : Oui

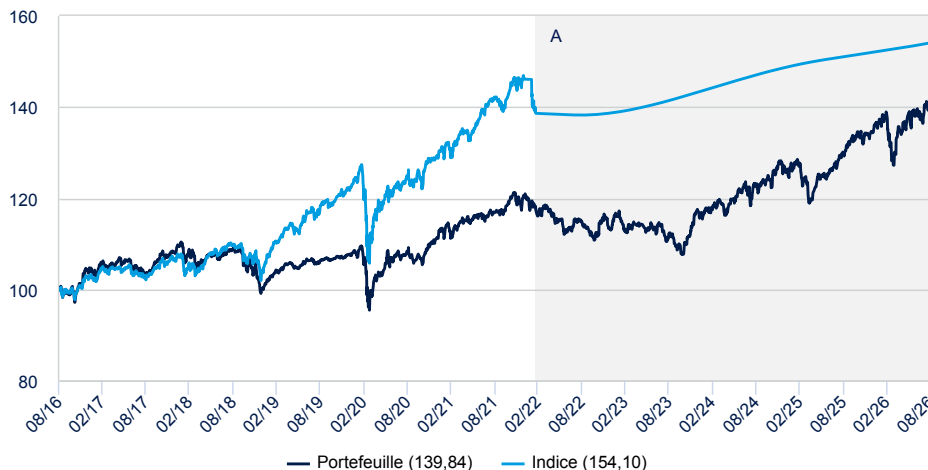
Tous les détails sont disponibles dans la documentation juridique

STRATEGIE D'INVESTISSEMENT (Source : Groupe Amundi)

Ce compartiment diversifié international vise à obtenir sur 4 ans minimum, une performance supérieure à son indice de référence avec une volatilité maximale prévisionnelle de 15%. L'exposition actions du portefeuille oscille entre 20% et 80% et sa sensibilité taux entre -2 et +5. Le compartiment est nourricier du FCP de droit français CPR Croissance Réactive.

ANALYSE DE LA PERFORMANCE (Source : Fund Admin)

EVOLUTION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE EN BASE 100 (Source : Fund Admin)



A : Since the beginning of this period, the reference indicator of the Sub-Fund is ?STR capitalized

PERFORMANCES NETTES PAR PERIODE GLISSANTE (Source : Fund Admin) *

Depuis le	Depuis le	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Depuis le
31/12/2025	31/07/2026	29/05/2026	29/08/2025	31/08/2023	31/08/2021	31/08/2016	11/04/2011	
Portefeuille	4,10%	1,53%	0,94%	7,82%	7,56%	3,65%	3,41%	5,09%
Indice	1,37%	0,19%	0,56%	2,04%	2,90%	1,66%	4,42%	5,89%
Ecart	2,74%	1,34%	0,38%	5,77%	4,66%	1,99%	-1,01%	-0,80%

* Les données supérieures à un an sont annualisées.

PERFORMANCES NETTES PAR ANNÉE CIVILE (Source : Fund Admin) *

	2025	2024	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016
Portefeuille	6,92%	7,13%	3,79%	-5,99%	7,90%	3,68%	7,13%	-6,98%	4,15%	4,25%
Indice	2,24%	3,79%	3,29%	-5,08%	12,92%	6,34%	16,92%	-1,96%	3,95%	6,61%
Ecart	4,69%	3,33%	0,50%	-0,91%	-5,02%	-2,66%	-9,80%	-5,02%	0,20%	-2,36%

* Les performances passées ne sont pas constantes dans le temps et ne sont pas un indicateur fiable des performances futures. Les investissements sont soumis aux fluctuations de marché et peuvent varier à la hausse comme à la baisse.

ANALYSE DU RISQUE (Source : Fund Admin) *

	1 an	3 ans	5 ans	Depuis le lancement *
Volatilité du portefeuille	7,83%	7,11%	6,67%	7,14%
Volatilité de l'indice	0,02%	0,12%	1,80%	6,09%
Ratio de Sharpe du portefeuille	0,74	0,68	0,24	0,64
Ratio de Sharpe de l'indice	0,00	0,00	-0,25	0,87
Perte maximale du portefeuille	-8,43%	-8,43%	-11,23%	-18,13%
Perte maximale de l'indice	-	-	-5,91%	-17,01%

* Données annualisées

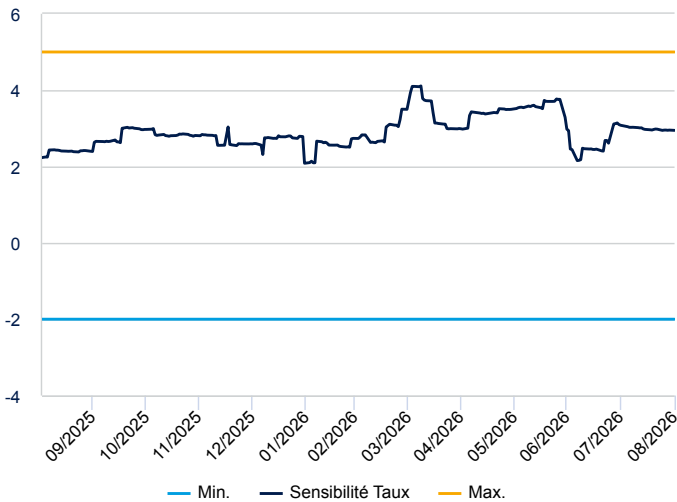
COMPOSITION DU PORTEFEUILLE DU FONDS MAITRE (Source : Groupe Amundi)

SYNTHESE (Source : Groupe Amundi)

	Portefeuille
Exposition Actions	56,66%
Sensibilité Taux	2,95
Nombre d'émetteurs (hors liquidités)	38

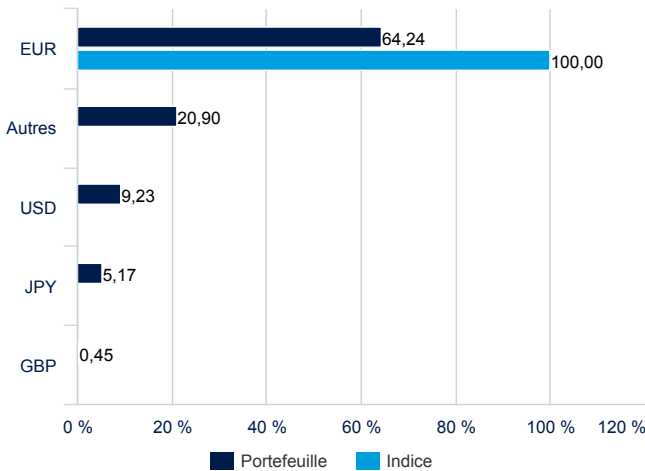
Evolution de la sensibilité taux (m-1) -0,13

EVOLUTION DE LA SENSIBILITE TAUX - 1 AN (Source : Amundi Groupe)



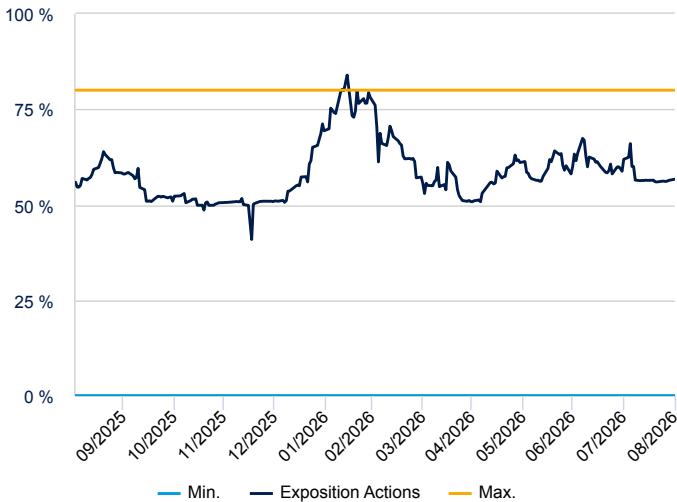
En points de sensibilité – avec prise en compte des produits dérivés.

EXPOSITION SUR LES PRINCIPALES DEVISES (Source : Groupe Amundi)



Evolution de l'exposition Actions (m-1) -5,23%

EVOLUTION DE L'EXPOSITION ACTIONS - 1 AN (Source : Amundi Groupe)



En pourcentage de l'actif – avec prise en compte des produits dérivés.

PRINCIPALES LIGNES EN PORTEFEUILLE (Source : Groupe Amundi) *

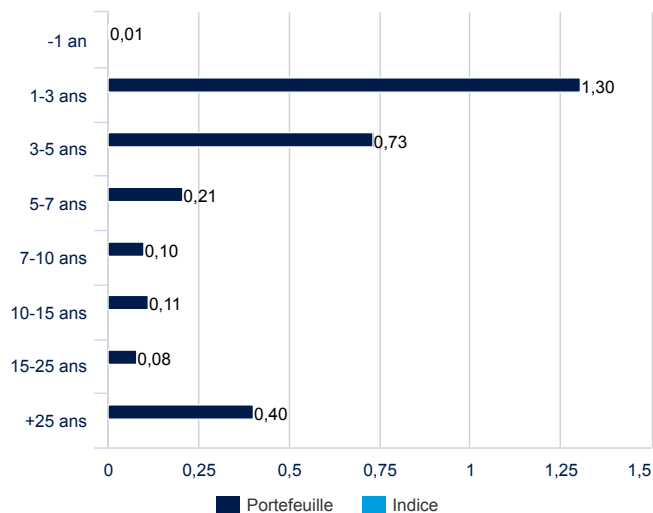
	Secteur	Poids (PTF)
AM EURO LIQUIDITY S-T RESP - Z (C)	Produits monétaires	8,59%
CPR INVEST - CLIMATE BONDS EURO - Z EUR	Obligations Crédit EMU	6,38%
AM MSCI WRLD SCREENED UCITS ETF (PAR)	Actions Internationales	5,68%
abrdn Em Mkt Lcl Ccy Dbt K Acc EUR	Etats émergents	5,41%
ARI - EUROPEAN CREDIT- I2 - C	Obligations Crédit EMU	4,93%
AMUNDI EURO LIQUIDITY SELECT - Z (C)	Produits monétaires	4,84%
CPR INVEST - CREDIXX GLOB HI YIELD	Haut rendement Monde	4,58%
AM EURO LIQUIDITY-RATED RESP - Z (C)	Produits monétaires	4,44%
CPR ABSOLUTE RETURN BONDS - Z (C)	Revenu fixe à rendement absolu	4,29%
Amu S&P EqI Wt ESG Ldrs ETFDRAcc USD (DE	Actions USA	4,17%

* Hors produits dérivés

ANALYSE DE LA SENSIBILITE TAUX (Source : Groupe Amundi)

RÉPARTITION PAR MATURITÉS

(Source : Groupe Amundi) *

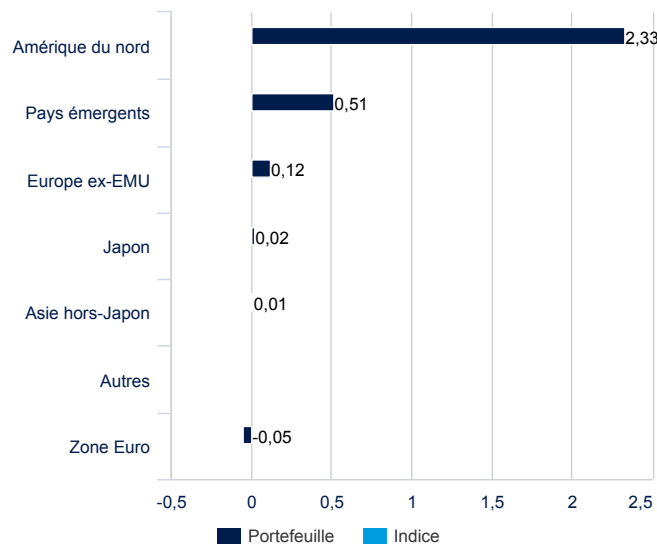


* En points de sensibilité – avec prise en compte des produits dérivés.

Sensibilité Taux 2,95

RÉPARTITION GÉOGRAPHIQUE

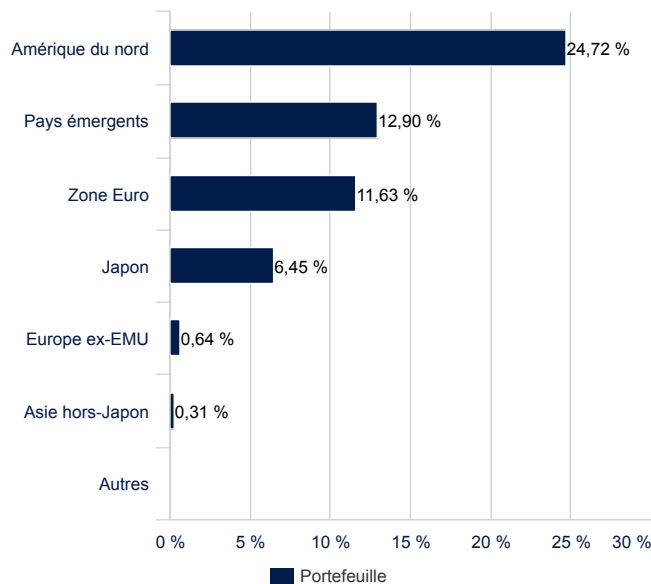
(Source : Groupe Amundi)



ANALYSE DE L'EXPOSITION ACTIONS (Source : Groupe Amundi)

RÉPARTITION GÉOGRAPHIQUE

(Source : Groupe Amundi) *

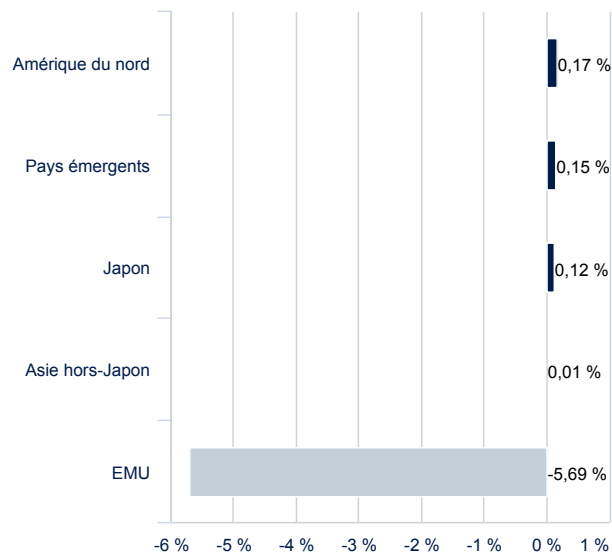


* En pourcentage de l'actif – avec prise en compte des produits dérivés.

Exposition Actions 56,66%

MOUVEMENTS GEOGRAPHIQUES AU COURS DU MOIS

(Source : Groupe Amundi)



EQUIPE DE GESTION

**Samir Saadi**

Gérant de portefeuille

COMMENTAIRE DE GESTION

Août 2026 a été marqué par la remontée des taux longs, alimentée par la volatilité du pétrole, resté élevé à 89\$ le Brent, sur fond d'impasse entre l'Iran et les États-Unis. Cette pression sur l'inflation a pesé sur les marchés obligataires, poussant le Trésor américain à annoncer un doublement des rachats de titres longs. Les statistiques d'inflation ont été contrastées : ralentissement aux États-Unis (CPI à 3,4%, core à 2,5%), mais accélération en zone euro à 2,9%, tirée par l'énergie, avec une inflation sous-jacente à 2,5%.

Les indicateurs d'activité sont restés solides : PMI en hausse en zone euro, ISM manufacturier et services bien orientés aux États-Unis. En revanche, l'emploi américain a déçu, malgré un chômage à 4,1%. Au Japon, le chômage a baissé à 2,4%, tandis qu'en Chine les PMI sont restés faibles.

Sur le plan monétaire, Jackson Hole a renforcé le biais hawkish : priorité à la stabilité des prix aux États-Unis, possible hausse des taux en septembre en zone euro, et resserrement anticipé au Japon.

Les marchés actions ont bien résisté, portés par le thème de l'IA notamment. À l'inverse, les taux d'intérêt ont progressé, pénalisant les actifs obligataires.

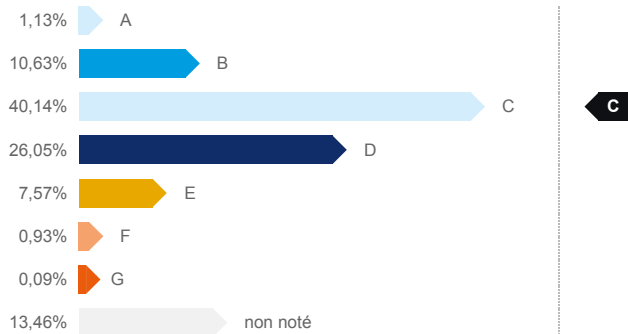
Notre allocation a profité sur le mois de l'exposition actions, et notamment de la diversification sur les émergents et le Japon. Il en a été de même sur l'exposition aux devises, notamment sur le Yen. La sensibilité taux, quoi que modérée, a amputé une partie de cette performance positive.

Notre scénario central reste celui d'une croissance mondiale résiliente et d'une normalisation graduelle de l'énergie, mais avec une inflation encore trop élevée pour desserrer rapidement les politiques monétaires. Nous restons positifs à moyen terme sur les actifs risqués, tout en gardant une approche tactiquement prudente face aux taux réels et aux valorisations.

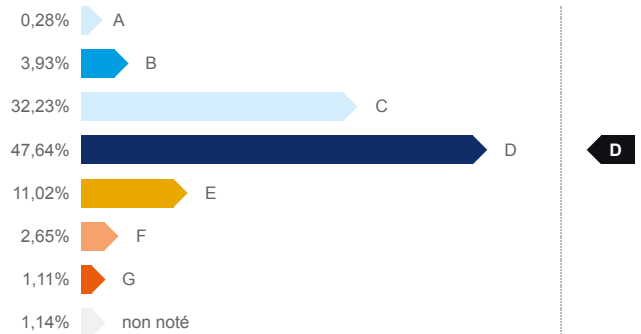
NOTE ESG MOYENNE (source : Amundi)

Notation Environnementale, Sociale et de Gouvernance

Du portefeuille



De l'indice de référence



Evaluation par composante ESG

	Portefeuille	Indice
Environnement	C	D
Social	C	D
Gouvernance	D	D
Note Globale	C	D

Couverture de l'analyse ESG

Nombre d'émetteurs	2 308
% du portefeuille noté ESG ²	97,72%

²Titres notables sur les critères ESG hors liquidités.

Définitions et sources

Investissement Responsable (IR)

L'ISR traduit les objectifs du développement durable dans les décisions d'investissements en ajoutant les critères Environnementaux, Sociaux et de Gouvernance (ESG) en complément des critères financiers traditionnels.

L'ISR vise ainsi à concilier performance économique et impact social et environnemental en finançant les entreprises et les entités publiques qui contribuent au développement durable quel que soit leur secteur d'activité. En influençant la gouvernance et le comportement des acteurs, l'ISR favorise une économie responsable.

Critères ESG

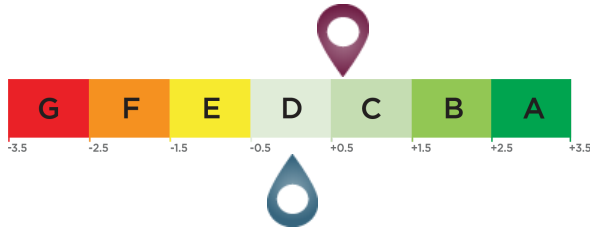
Des critères extra-financiers sont utilisés pour évaluer les pratiques Environnementales, Sociales et la Gouvernance des entreprises, Etats ou collectivités :

- o « E » pour Environnement : consommation d'énergie, émissions de gaz à effet de serre, gestion de l'eau et des déchets...
- o « S » pour Social/Sociétal : respect des droits de l'homme, santé et sécurité au travail...
- o « G » pour Gouvernance : indépendance du conseil d'administration, respect des droits des actionnaires ...

L'échelle de notation du Groupe Amundi classe les émetteurs de A à G, A étant les meilleurs émetteurs et G les plus mauvais.

NOTE ESG MOYENNE (source : Amundi)

Notation Environnementale, Sociale et de Gouvernance

Univers d'investissement ESG: 100% INDEX AMUNDI ESG RATING D

Score du portefeuille d'investissement: 0,63

Score de l'univers d'investissement ESG¹: 0,00

Lexique ESG**Critères ESG**

Il s'agit de critères extra-financiers utilisés pour évaluer les pratiques Environnementales, Sociales et la Gouvernance des entreprises, Etats ou collectivités :

« E » pour Environnement (niveau de consommation d'énergie et de gaz, gestion de l'eau et des déchets...).

« S » pour Social/Sociétal (respect des droits de l'homme, santé et sécurité au travail...).

« G » pour Gouvernance (indépendance du conseil d'administration, respect des droits des actionnaires ...).

Notes ESG

Note ESG de l'émetteur : chaque émetteur est évalué sur la base de critères ESG et obtient un score quantitatif dont l'échelle est basée sur la moyenne du secteur. Le score est traduit en note sur une échelle allant de A (le meilleur niveau) à G (le moins bon). La méthodologie d'Amundi permet une analyse exhaustive, standardisée et systématique des émetteurs sur l'ensemble des régions d'investissements et des classes d'actifs (actions, obligations, etc.).

Note ESG de l'univers d'investissement et du portefeuille: le portefeuille et l'univers d'investissement se voient attribuer un score ESG et une note ESG (de A à G). Le score ESG correspond à la moyenne pondérée des scores des émetteurs, calculée en fonction de leur pondération relative dans l'univers d'investissement ou dans le portefeuille, hors actifs liquides et émetteurs non notés.

Intégration de l'ESG chez Amundi

En plus de se conformer à la politique d'investissement responsable d'Amundi⁴, les portefeuilles d'Amundi intégrant l'ESG ont un objectif de performance ESG qui vise à atteindre un score ESG pour leur portefeuille supérieur au score ESG de leur univers d'investissement ESG.

Couverture ESG (source: Amundi) *

	Portefeuille	Univers d'investissement ESG
Pourcentage avec une notation ESG Amundi ²	97,72%	100,00%
Pourcentage pouvant bénéficier d'une notation ESG ³	93,85%	100,00%

* Titres notables sur les critères ESG. Le total peut être différent de 100% pour refléter l'exposition réelle du portefeuille (prise en compte du cash).

¹ La référence à l'univers d'investissement est définie par l'indicateur de référence du fonds ou par un indice représentatif de l'univers ESG investissable.

² Pourcentage de titres du portefeuille total ayant une note Amundi ESG (en termes de pondération)

³ Pourcentage de titres du portefeuille total pour lesquels une méthodologie de notation ESG est applicable (en termes de pondération).

⁴ Le document mis à jour est disponible à l'adresse <https://www.amundi.com/int/ESG>.

Niveau de durabilité (source : Morningstar)

Le niveau de durabilité est une notation produite par la société Morningstar qui vise à mesurer le niveau de responsabilité d'un fonds de façon indépendante sur la base des valeurs en portefeuille. La notation s'établit de très faible (un globe) à très élevé (5 globes). L'obtention de cette notation par le compartiment ne signifie pas que celui-ci réponde à vos propres objectifs en matière de durabilité.

Source Morningstar ©

Sustainability Score – sur la base des analyses de risques ESG fournies par Sustainability sur les entreprises, utilisées dans le calcul du score de durabilité de Morningstar.

© 2026 Morningstar. Tous droits réservés. Les informations contenues ici : (1) appartiennent à Morningstar et/ou ses fournisseurs de contenu ; (2) ne peuvent être reproduites ou redistribuées ; et (3) ne sont pas garanties d'exactitude, d'exhaustivité ou d'actualité. Ni Morningstar, ni ses fournisseurs de contenu ne sont responsables en cas de dommages ou de pertes liés à l'utilisation de ces informations. Les performances passées ne garantissent pas les résultats futurs. Pour plus d'informations sur le rating Morningstar, veuillez consulter leur site www.morningstar.com.