



FR0007076047

Reporting mensuel – 30 juin 2016

MORNINGSTAR ★★★★★ Notations au 31/05/2016

Chiffres Clés

Valeur liquidative Part I : 1 723.41€

Actif net Part I : 10.87M€

Actif net fonds : 169.50M€

Actif net maître : 236.01M€

Horizon de placement

1 ans	2 ans	3 ans	4 ans	5 ans
-------	-------	-------	-------	-------

Profil de risque et de rendement

1	2	3	4	5	6	7
---	---	---	---	---	---	---

Caractéristiques

Forme juridique : FCP - UCITS IV

Classification AMF : Obligations et autres titres de créances libellés en euro

Type de part : Part I

Date de création : 12/09/2002

Indice de référence : Barclays Capital Euro Government Inflation Linked Bond Index

Ancien indice jusqu'au 02/07/12 : Indice Barclays Indexés français

Affectation des résultats : Capitalisation

Fréquence de valorisation : Quotidienne

Devise de référence : Euro

Clientèle : Investisseurs institutionnels

Risques supportés : taux, inflation, arbitrage, crédit, défaut, perte en capital

Fourchette de sensibilité : entre 0 et 10

Informations Commerciales

Code ISIN : FR0007076047

Code Bloomberg : LFPILTC FP Equity

Droits d'entrée max : 4.0%

Droits de sortie max : Néant

Frais de gestion max : 0.98% TTC

Frais de gestion variables : 20% TTC de la performance au-delà de l'indice Barclays Capital Euro Government Inflation Linked Bond Index-Plafoignée à 2.5% de l'actif net

Centralisation des ordres : J avant 9H15

Règlement : J+2

Souscription initiale min. : 100 000 €

Dépositaire : BNP Paribas Securities Services

Valorisateur : BNP Paribas Fund Services France

Société de gestion : La Française Asset Management

Gérant : François COLLET

Document à destination des non professionnels et professionnels au sens de la MIF - Document non contractuel - Avant toute souscription, prenez connaissance du prospectus disponible sur internet : www.lafrancaise-group.com
Sources : La Française Asset management, données comptables, Bloomberg

Stratégie d'investissement

La Française Euro Inflation (ex La Française Index Long Terme) a pour objectif d'obtenir une performance nette de frais supérieure au Barclays Capital Euro Government inflation-linked Bond Index, sur la période de placement recommandée, supérieure à 3 ans.

Performances nettes en EUR

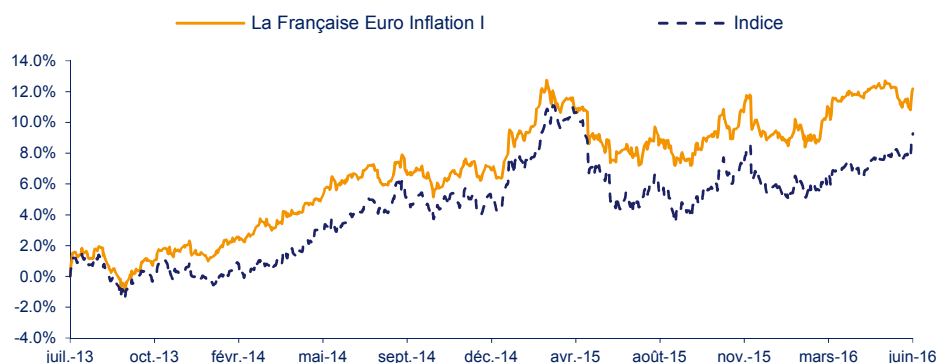
Les performances passées ne préjugent pas des performances futures et ne sont pas constantes dans le temps

Cumulées	1 mois	3 mois	2016	1 an	3 ans	5 ans	Création*
Fonds	-0.28%	0.48%	2.71%	3.51%	12.62%	24.94%	72.34%
Indice de référence	1.28%	2.09%	3.28%	4.15%	9.70%	16.51%	83.49%

Annualisées	1 an	3 ans	5 ans	Création*
Fonds	3.50%	4.03%	4.55%	4.02%
Indice de référence	4.14%	3.12%	3.10%	4.49%

* Création le 12/09/02

Evolution de la performance nette sur 3 ans



Indicateurs de risque

Sensibilité taux	5.51		
Fréquence hebdo	1 an	3 ans	5 ans
Volatilité Fonds	4.48%	4.18%	6.15%
Volatilité indice	4.20%	4.31%	5.33%
Ratio de sharpe	0.64	0.89	0.68

* sur les titres en portefeuille

Analyse des rendements

	Sur 5 ans
Gain maximum	39.68% (du 24/11/11 au 12/03/15)
Max. Drawdown	-10.26% (du 01/07/11 au 24/11/11)
Recouvrement	56 jours (le 19/01/12)
Meilleur mois	6.68% (déc-11)
Moins bon mois	-3.60% (nov-11)
% Mois >0	61.67%
% Mois surperf.	63.33%

Historique des performances nettes mensuelles en %

	Janv	Févr.	Mars	Avr.	Mai	Juin	Juil.	Août	Sept.	Oct.	Nov.	Déc.	Année
2016 Fonds	0.91	-1.31	2.63	0.26	0.50	-0.28							2.71
2016 Indice	0.68	-0.86	1.36	-0.14	0.94	1.28							3.28
2015 Fonds	1.75	1.94	-0.01	-0.02	-1.77	-0.48	1.23	-1.91	0.70	1.66	1.26	-2.10	2.16
2015 Indice	2.41	0.87	1.19	-0.39	-2.15	-1.87	1.65	-2.29	0.60	2.24	1.12	-2.38	0.82
2014 Fonds	1.16	0.80	0.31	0.94	1.24	0.77	0.52	0.23	-0.33	-0.63	0.88	-0.39	5.62
2014 Indice	1.08	-0.03	0.42	0.94	1.15	0.76	0.80	1.15	-0.62	-0.22	0.33	-0.56	5.27
2013 Fonds	-1.59	-0.03	0.42	2.12	-1.13	-3.29	1.59	-1.02	0.23	1.44	0.17	-0.78	-1.97
2013 Indice	-1.46	-0.11	0.60	1.46	-1.31	-3.14	1.29	-1.35	0.58	1.00	-0.52	-0.90	-3.90
2012 Fonds	2.62	2.88	0.18	-0.49	0.99	0.19	2.93	2.20	0.84	-0.54	1.98	1.05	15.76
2012 Indice	2.37	0.83	0.32	-0.20	1.94	-1.00	3.46	0.36	0.29	-0.55	1.25	0.91	10.36



FR0007076047

Données par transparence du fonds maître (La Française LUX - Euro Inflation - F (C) EUR)

Reporting mensuel - 30 juin 2016

Structure du Portefeuille

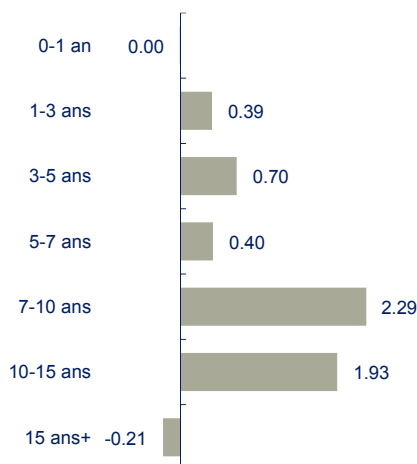
En % actif net



- Obligations indexées : 146.08%
- Liquidités : 2.36%
- Obligations taux fixe : -48.44%

Sensibilité par maturité

Contribution à la sensibilité



Répartition par type d'indexation

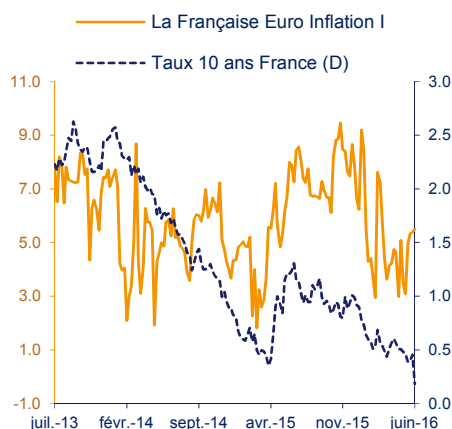
En % actif net

Type d'indexation

Zone Euro	140.34%
Core Euro	92.35%
Périphériques	47.99%
Etats-Unis	5.74%
Autres	0.00%
Total	146.08%

Evolution de la sensibilité taux

Sensibilité du fonds : 5.51



Principaux émetteurs

Libellé	Secteur	Note*	Contrib. Sensi	% actif
Etat Italien	Etat Zone Euro	BBB-	2.70	45.35%
Etat Français	Etat Zone Euro	AA	2.63	33.64%
Etat Allemand	Etat Zone Euro	AAA	2.35	16.28%
Etat Espagnol	Etat Zone Euro	BBB	0.31	2.63%

*correspond au rating le plus récent entre S&P et Moody's

