

SCR Optimum

Fonds innovant pour investir sur des actifs bien traités en Solvabilité 2

Rapport mensuel au

31/12/2020



Alexandre Ferri

David Letellier

Christophe Gautier

Gestion à performance absolue (L/S equity Market Neutral)

Estimation du Market SCR au 30/06/20

SCR Int Rates UP	0,00%
SCR Int Rates DOWN	0,00%
SCR Spread	0,00%
SCR Equity	1,21%
SCR Currency	0,00%
SCR Default	0,00%
SCR Market Risk Concentrations	NA
Market SCR	1,21%

*SCR : Solvency Capital Requirement

Risques du fonds : Les risques auxquels s'expose le porteur au travers du FCP sont principalement, actions, taux, crédit et produits dérivés. L'OPCVM ne bénéficie d'aucune garantie ou protection du capital et le porteur de part est donc exposé à un risque de perte en capital.

Exposition

Exposition nette au risque Action (Beta ajusté) :	6,83%
Liquidités & Monétaires :	5,38%
Risque de change :	Non
Volatilité sur 1 an :	5,54%
Taux de rotation 2019 (Turnover ratio)	0,86
Max drawdown :	15,17%
Nombre de lignes :	29

Performances

Année	Fonds	Indice *
2020	-2,79%	-0,46%
2019	-3,42%	1,11%
2018	-5,07%	-0,81%
2017	6,33%	0,26%
2016	-3,24%	0,31%
2015	2,80%	-0,30%

* 5% CAC 40 dividendes nets + 30% FTSE MTS 1-3 ans + 65% EONIA (OIS)

Principaux mouvements

Achats		Ventes	
EURO STOXX 50	Mar21	ESKER SA	
-		LVMH	
-		-	
-		-	
-		-	
-		-	

Principales positions longues du portefeuille

EURO STOXX BANK	Mar21	Couvertures	6,45%
LIQUIDITES		Liquidités	5,38%
PEUGEOT SA		Actions	5,03%
AIR LIQUIDE SA		Actions	4,83%
SCHNEIDER ELECTRIC SE		Actions	4,79%
SAP SE		Actions	4,34%
SAFRAN SA		Actions	4,00%
PERNOD RICARD SA		Actions	4,00%
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		Actions	3,99%

Position courte du portefeuille

EURO STOXX 50	Mar21	Couvertures	-93,41%
---------------	-------	-------------	---------

Caractéristiques de l'OPC

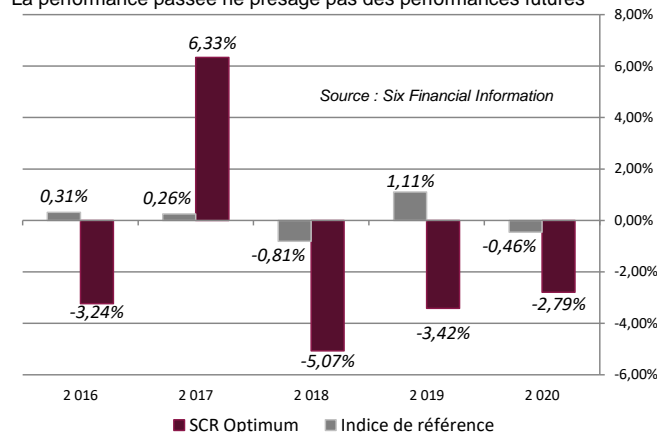
SCR Optimum est un fonds spécialisé dans la prise de positions simultanées à l'achat et à la vente sur des actions de toutes tailles de capitalisation, de tous secteurs géographiques de la zone euro et de tous secteurs économiques cotés sur des grands marchés européens. Le gérant veille à équilibrer, dans le montant des capitaux engagés, les positions acheteuses et vendeuses en portefeuille pour que la somme de celles-ci soit la plus proche de zéro.

Echelle de risque

Faible							Elevé
1	2	3	4	5	6	7	

Evolution de la performance 5 ans

La performance passée ne préjuge pas des performances futures



Caractéristiques

Code ISIN : FR0012453348 (part I) / FR0013141934 (part A)

Classification AMF : -

Classification Morningstar : Alt - Market Neutral - Actions

Ticker Bloomberg : SCROPTI FP / SCROPTA FP

FCP créé le 31 mars 2015

Affectation des résultats : Capitalisation

Durée minimale de placement recommandée : > à 2 ans

Valeur de la part "I" : 94 265,21 €

Valeur de la part "A" : 88,21 €

Actif net : 33 330 105,48 €

Périodicité de la valorisation : Quotidienne

Indice de référence : 5% CAC 40 dividendes réinvestis

+ 30% FTSE MTS 1-3ans + 65%EONIA Capitalisé

Frais de gestion : 0,60% TTC (part I) / 1,20% TTC (part A)

Commission de superperformance : 20 % TTC au-delà de l'indice

avec High water mark

Droits d'entrée / sortie : Néant

Dépositaire : CIC (Crédit Industriel et Commercial)

Valorisateur : CM-CIC AM

Commissaire aux comptes : KPMG SA

Mise à jour du prospectus : Janvier 2020

Conditions de souscription : Avant 11h00 cours inconnu

Contactez la Société de Gestion

actis asset management

68, avenue des Champs Elysées - 75008 Paris

Tél : + (33) 1 53 23 04 90

Fax : + (33) 1 53 23 04 31

Adresse Email :

contact@actis-am.fr

Site internet :

<http://www.actis-am.fr>



Ce document est un document non contractuel, strictement limité à l'usage privé du destinataire, diffusé à des fins d'information et ne saurait en aucun cas s'interpréter comme constituant une offre de vente ou sollicitant une offre d'achat de titres qui y sont mentionnés. L'opinion formulée dans le présent document ne saurait en aucun cas se substituer au jugement de son destinataire. Les informations fournies dans ce document n'ont aucun caractère exhaustif et leurs précisions ne peuvent être garanties. Les appréciations formulées reflètent l'opinion d'Actis Asset Management à la date de publication et sont susceptibles d'être révisées ultérieurement. Si le présent document fait référence à un traitement fiscal particulier, l'investisseur est conscient qu'une telle information dépend de la situation individuelle de chaque investisseur et qu'elle est susceptible d'être modifiée ultérieurement. Avant toute souscription l'investisseur doit se procurer et lire attentivement le DICI-Prospectus du FCP disponible sur le site Internet de la Société de gestion.

SCR Optimum

Fonds innovant pour investir sur des actifs bien traités en Solvabilité 2

Gestion à performance absolue (L/S equity Market Neutral)

Rapport mensuel au

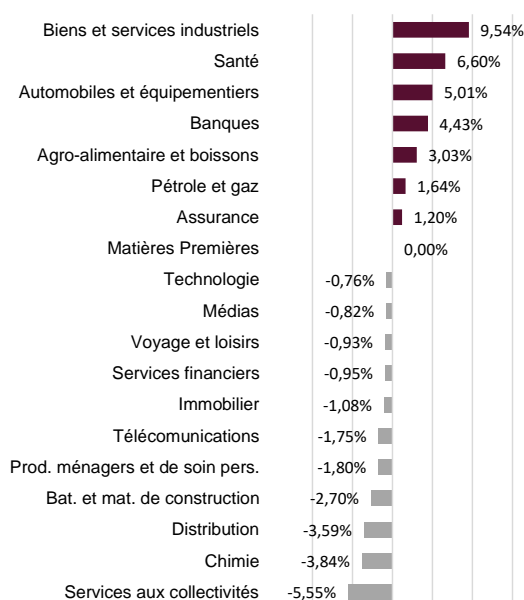
31/12/2020

Performances annuelles et mensuelles

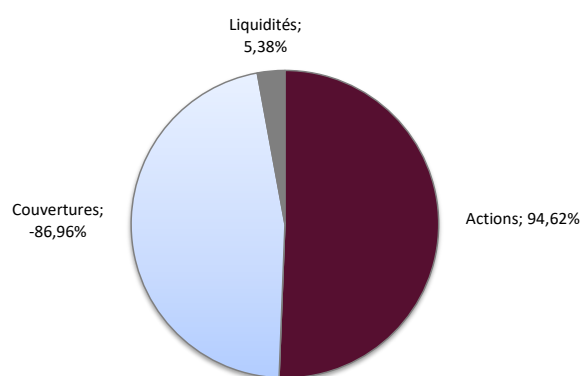
		Janv.	Fév.	Mars	Avril	Mai	Juin	Juil.	Août	Sept.	Oct.	Nov.	Dec.	YTD
2015	Fonds	-	-	-	1,20%	1,13%	-1,05%	0,68%	0,06%	0,18%	0,21%	-0,31%	0,67%	2,80%
	Indice	-	-	-	0,00%	0,03%	-0,26%	0,36%	-0,47%	-0,18%	0,48%	0,10%	-0,36%	-0,30%
2016	Fonds	1,99%	0,52%	-0,52%	-1,22%	0,58%	-1,04%	0,89%	-0,14%	0,90%	-2,98%	-0,56%	-1,61%	-3,24%
	Indice	-0,19%	-0,09%	0,03%	0,04%	0,16%	-0,27%	0,21%	-0,02%	0,01%	-0,02%	0,06%	0,39%	0,31%
2017	Fonds	1,09%	0,11%	0,36%	1,48%	1,10%	1,12%	0,03%	0,08%	0,24%	-0,32%	-0,14%	1,02%	6,33%
	Indice	-0,25%	0,16%	0,25%	0,16%	0,07%	-0,21%	-0,01%	-0,02%	0,21%	0,17%	-0,16%	-0,11%	0,26%
2018	Fonds	0,32%	0,21%	-0,72%	-0,80%	0,74%	-0,11%	-0,43%	0,49%	-0,44%	-2,93%	-0,98%	-0,50%	-5,07%
	Indice	0,12%	-0,17%	-0,11%	0,31%	-0,33%	0,02%	0,14%	-0,24%	0,10%	-0,38%	-0,03%	-0,23%	-0,81%
2019	Fonds	-0,64%	0,45%	-0,63%	-0,23%	-1,62%	-0,53%	0,31%	0,72%	-1,77%	-0,14%	-0,05%	0,69%	-3,42%
	Indice	0,27%	0,20%	0,15%	0,21%	-0,31%	0,38%	-0,01%	-0,01%	0,12%	-0,04%	0,10%	0,04%	1,11%
2020	Fonds	0,56%	-0,18%	-1,31%	-0,01%	-1,40%	-2,44%	0,37%	-0,05%	-1,12%	-0,19%	2,98%	0,04%	-2,79%
	Indice	-0,15%	-0,52%	-1,05%	0,15%	0,15%	0,36%	-0,17%	0,14%	-0,15%	-0,22%	1,02%	-0,02%	-0,46%

La performance passée ne présege pas des performances futures

Répartition sectorielle

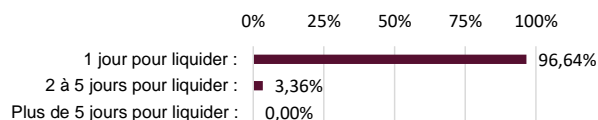


Répartition par type d'instrument

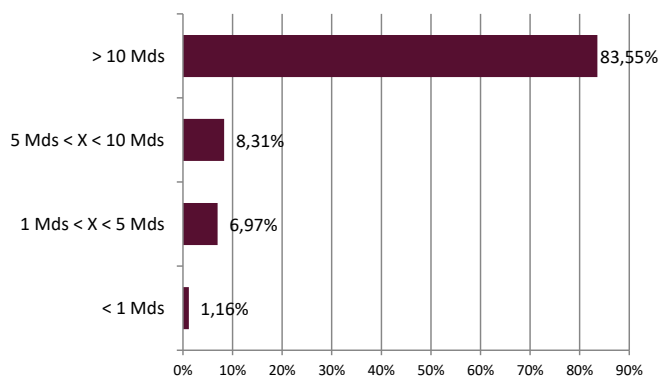


Liquidité des actions détenues

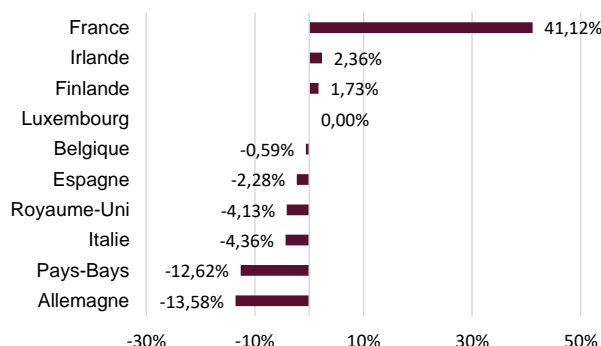
Note : A raison d'un taux de participation d'1/3 du volume quotidien de la moyenne constatée sur les 6 derniers mois



Capitalisation boursière (en milliards d'euros)



Répartition géographique (nette)



Contactez la Société de Gestion

actis asset management

68, avenue des Champs Elysées - 75008 Paris

Tél : + (33) 1 53 23 04 90

Fax : + (33) 1 53 23 04 31

Adresse Email :

contact@actis-am.fr

Site internet :

<http://www.actis-am.fr>



Ce document est un document non contractuel, strictement limité à l'usage privé du destinataire, diffusé à des fins d'information et ne saurait en aucun cas s'interpréter comme constituant une offre de vente ou sollicitant une offre d'achat de titres qui y sont mentionnés. L'opinion formulée dans le présent document ne saurait en aucun cas se substituer au jugement de son destinataire. Les informations fournies dans ce document n'ont aucun caractère exhaustif et leurs précisions ne peuvent être garanties. Les appréciations formulées reflètent l'opinion d'Actis Asset Management à la date de publication et sont susceptibles d'être révisées ultérieurement. Si le présent document fait référence à un traitement fiscal particulier, l'investisseur est conscient qu'une telle information dépend de la situation individuelle de chaque investisseur et qu'elle est susceptible d'être modifiée ultérieurement. Avant toute souscription l'investisseur doit se procurer et lire attentivement le DICI-Prospectus du FCP disponible sur le site Internet de la Société de gestion.