

Actualité **Produits**

## Palmarès des fonds diversifiés selon la nouvelle échelle de risque (vous allez être surpris)...

Publié le jeudi 2 mars 2023




Depuis le 1<sup>er</sup> janvier dernier, la Réglementation Européenne PRIIPS (Packaged Retail and Insurance-based Investment Products) est entrée en application pour les fonds d'investissement. Les niveaux de risque ont changé, passant du SRRI (Synthetic Risk and Reward Indicator) au SRI (Summary Risk Indicator). Ils suivent toujours une échelle de 1 à 7 (du risque le plus faible au plus élevé) mais la méthode introduit désormais la dimension du risque de crédit.

La nouvelle échelle de risque, toujours de 1 à 7, est dite SRI (Synthetic Risk Indicator). Mais la méthodologie change et inclut le risque de crédit.


« **Le SRI est une matrice intégrant le risque marché sur une dimension et le risque crédit sur une autre.** Par exemple, pour un fonds multi-asset dont le risque crédit est de 4 et le risque marché de 4, le SRI sera de 5/7. Pour les fonds actions, le risque crédit est de 1 (aucun risque crédit) », explique **Pictet Asset Management**.

De nombreux fonds voient ainsi **leur note de risque diminuer de 1 ou 2 niveaux**, sans pour autant que la stratégie du fonds n'ait évoluée !

Exemples :

-  Carmignac Patrimoine passe d'un SRRI 4 à un SRI 3 ;
-  H2O Moderato passe d'un SRRI 6 à un SRI 5 ;
-  R-Co Valor passe d'un SRRI 6 à un SRI 4...

### Palmarès de quelques fonds diversifiés selon leur nouveau "SRI" (extrait)

SRI 4	
GF Ambition Solidaire	+10,41% YTD
R-co Valor	+8,03% YTD
VEGA Patrimoine ISR	+6,31% YTD
 Cogefi Flex Dynamic	+6,1% YTD
ACATIS Value Event	+4,99% YTD
IDE Dynamic World Flexible	+4,05% YTD
First Eagle Amundi International Fund	+4% YTD
Ecofi Agir Pour Le Climat	+2,86% YTD
OFI Invest ESG MultiTrack	+2,05% YTD
AXA WF Global Optimal Income	-0,24% YTD