

Le 19 décembre 2016

Baisse de la performance de toutes les catégories d'OPC

En octobre 2016, la performance des OPC non monétaires redevient négative en rythme annuel (-0,4%) et enregistre une baisse de 3,9 points par rapport au mois précédent. Cette baisse généralisée de la performance, conforme à l'évolution des marchés financiers (cf. graphiques), est particulièrement marquée pour les fonds actions (-7,7 points par rapport à septembre 2016, à -3,5% en octobre 2016). La performance annuelle des fonds diversifiés (-0,1%) et des autres fonds (+0,2%) décroche moins tandis que celle des fonds obligations demeure nettement positive, à 2,5%. La performance annuelle des fonds monétaires reste très légèrement positive à 0,02% en octobre.

Performance annuelle des OPC par catégorie (a)

(en pourcentage, encours en milliards d'euros)

	2013	2014	2015	sept.-16	oct.-16	encours oct-16
FONDS NON MONÉTAIRES	8,6	5,4	5,1	3,5	-0,4	1 073
Fonds actions	18,5	6,9	10,0	4,2	-3,5	289
<i>dont : - actions françaises</i>	21,1	2,7	13,9	5,3	-2,1	23
<i>- actions de pays de la zone euro</i>	22,8	3,2	12,9	3,1	-4,4	80
<i>- actions de l'UE et internationales</i>	17,2	8,7	9,1	4,9	-3,2	137
<i>- fonds indiciels (b)</i>	14,0	10,0	5,7	3,5	-3,7	49
Fonds obligations	0,8	5,1	0,9	3,9	2,5	255
<i>dont obligations et autres titres de créances libellés en euro</i>	1,5	5,7	0,3	3,6	2,1	170
Fonds diversifiés	6,1	5,4	3,0	3,2	-0,1	331
Fonds autres (c)	8,5	3,4	6,5	2,6	0,2	198
<i>dont fonds d'épargne salariale</i>	12,8	3,4	6,9	2,2	-1,3	116
FONDS MONÉTAIRES	0,21	0,37	0,18	0,03	0,02	361

Source : Banque de France

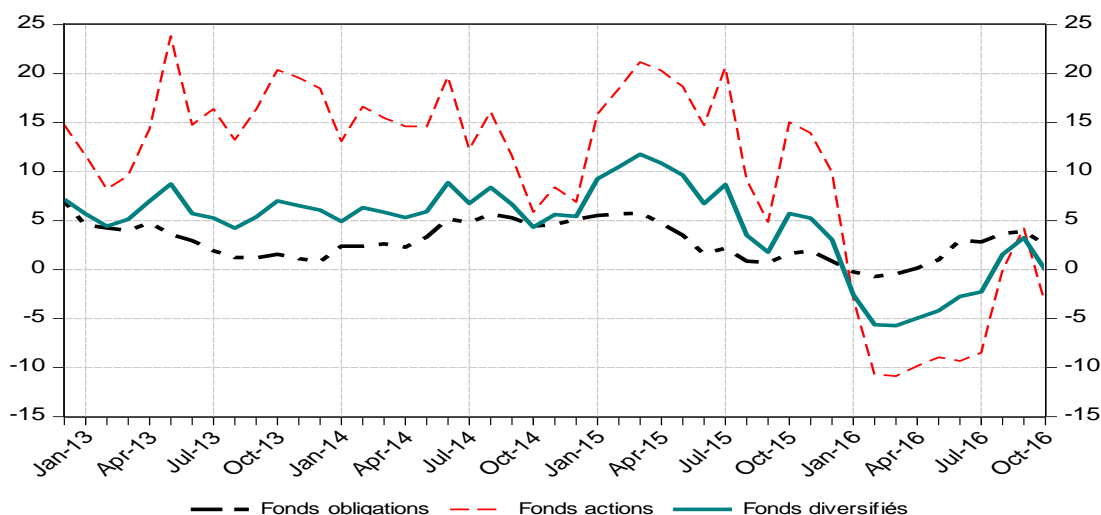
(a) Performance annuelle nette des frais de gestion mais avant déduction des éventuels frais d'entrée et de sortie (cf. méthodologie).

(b) Les fonds indiciels sont aussi nommés ETF (Exchange Trade Fund)

(c) Fonds à formule, fonds de capital investissement, « hedge funds » et fonds d'épargne salariale

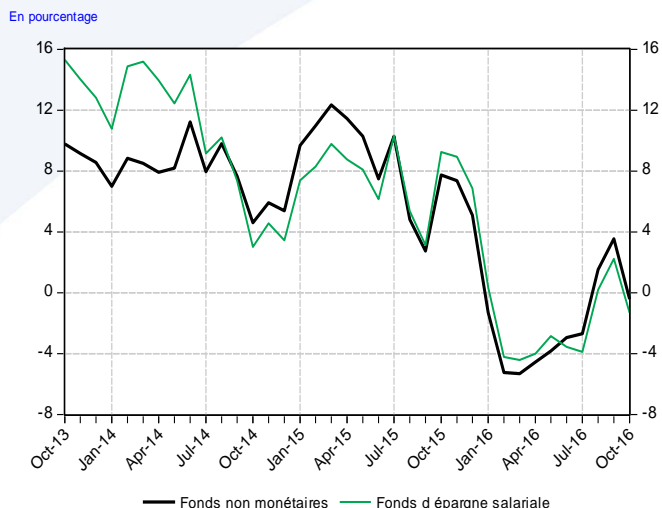
Performance annuelle des OPC actions, obligations et diversifiés

En pourcentage

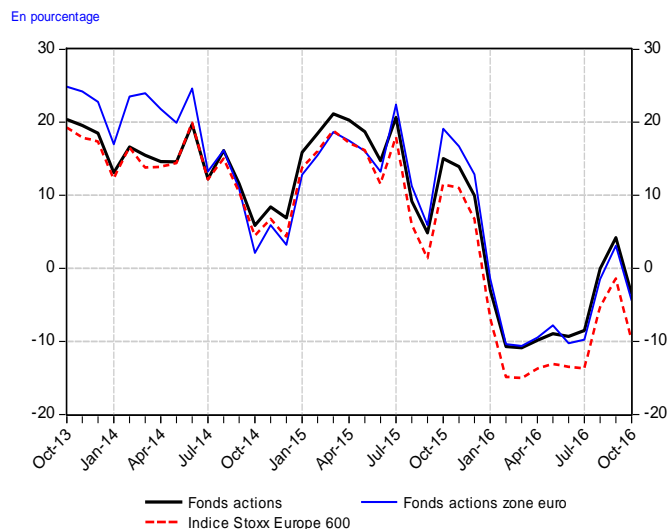


¹ OPC : Organismes de placement collectif

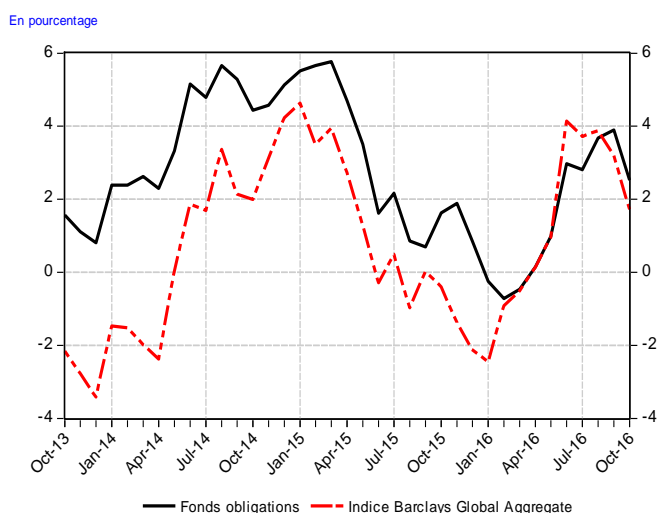
Performance des fonds non monétaires et fonds d'épargne salariale (a)



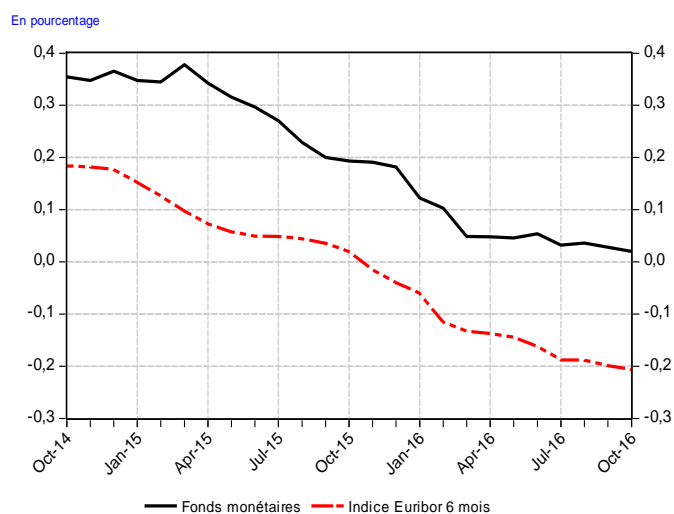
Performance des fonds actions (a)



Performance des fonds obligations (a)



Performance des fonds monétaires (a)



Source : Banque de France, Barclays

(a) Performance annuelle nette des frais de gestion mais avant déduction des éventuels frais d'entrée et de sortie (cf. méthodologie).

Complément

Les catégories de fonds présentées sous revue sont issues de la nomenclature définie par l'Autorité des Marchés Financiers (AMF). La classification d'un fonds est déterminée en fonction de son exposition réelle aux risques dont le calcul et les seuils sont définis par les instructions AMF n° 2011-19, 2011-20 et 2011-21.

L'indice Stoxx Europe 600 est constitué de 600 entreprises résidentes dans 18 pays européens.

L'indice Barclays est constitué d'obligations souveraines et quasi souveraines ainsi que d'obligations d'entreprises et de titres adossés à des actifs. Il couvre des émissions libellées en 24 devises sur des marchés développés et émergents. L'échéance résiduelle est supérieure à un an et les titres sont notés « investment grade ».

Les demandes d'abonnement aux Stat info peuvent être adressées à : 2503-DIFFUSION-UT@banque-france