26/09/2018

Rapport réalisé par :
Arnaud Sylvain
Cabinet arnaud Sylvain
38 rue des Canaris
44300 Nantes

Proposition

powered by Quantalys

CARACTERISTIQUES DE L'INVESTISSEMENT

Le montant et la durée de votre investissement, ainsi que le profil de risque déclaré ou calculé, sont indiqués ci-contre. Avec les éléments fournis, la volatilité maximale de votre investissement est : 10%

Caractéristiques de l'investissement

Montant total :	50 000 euros
Durée :	15 ans

Objectifs de l'investissement :

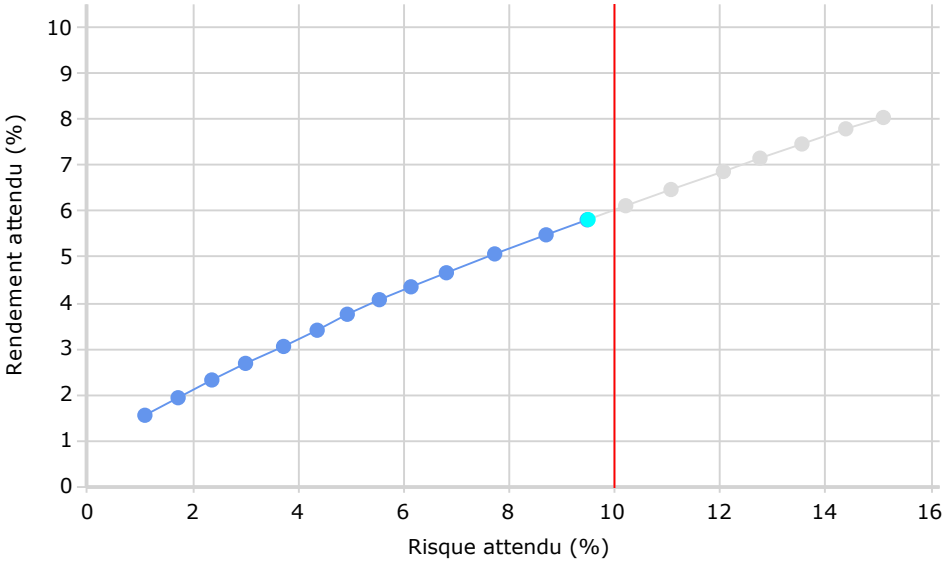
-Respecter une volatilité maximale de 10 %

Profil de risque : Prudent (Manuel : 09/03/2018)

Volatilité maximale acceptable : 10 %

ALLOCATION D'ACTIFS CHOISIE

En fonction de la durée déclarée de l'investissement, nous vous proposons une plage d'allocations d'actifs optimales sur la frontière efficiente Quantalys. Le profil de risque déclaré ou calculé sert à proposer un point au sein de la plage optimale.



Proposition

Volatilité max acceptable

Détail de l'allocation d'actifs

Le détail de l'allocation d'actifs retenue est indiqué dans le graphique ci-contre. Elle se compose à 20% de flexibles, 29% d'obligataire, 51% d'actions.

Classes d'actifs	Alloc. cible	Proposition
Monétaire	-	-
Obligations Europe	20 %	19,95 %
Obligations Monde	9 %	8,96 %
Actions France	10 %	9,99 %
Actions Europe	12 %	12,04 %
Actions Etats-Unis	20 %	19,95 %
Actions Pacifique	6 %	6,05 %
Actions Emergentes	3 %	3,04 %
Flexibles	20 %	20,03 %

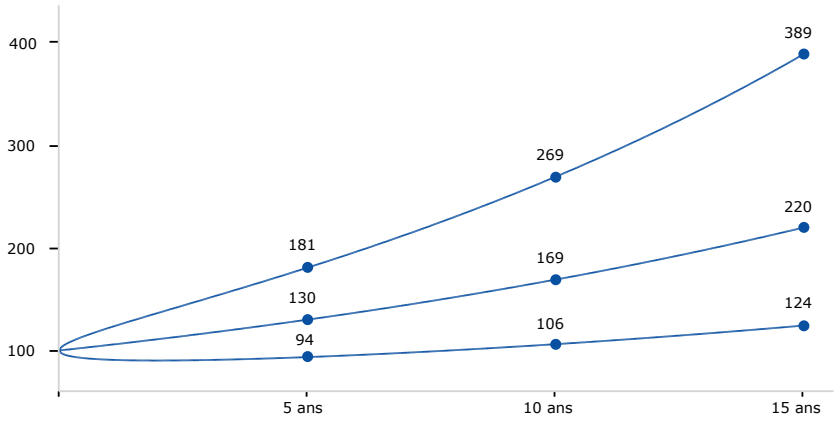
Analyse de la performance attendue

Le rendement et le risque annuels attendus de sont indiqués ci-contre, ainsi que l'espérance de gain totale et le gain minimum attendus en fin de période et la perte maximum attendue pendant la période indiquée. Cette simulation est faite avec un intervalle de confiance de 5% et les données ne sont pas garanties. Dans % des cas, la perte pourra être plus élevée que les maxima calculés, sans que le montant de cette perte soit connu.

	Proposition
Rendement annuel attendu :	5,82 %
Risque annuel attendu :	9,49 %
Espérance de gain moyen à 15 ans :	119,91 %
Rendement minimal à 15 ans :	24,32 %
Perte maximale au cours des 15 ans :	-9,81 %

Evolution de l'investissement

Ce graphique représente la plage d'évolution de la performance de la proposition sur la durée indiquée. La branche supérieure représente la meilleure performance, la branche inférieure la pire performance, la branche du milieu la performance moyenne attendue. L'espace compris entre les deux branches représente 90% des résultats possibles : dans 10% des cas, la performance de l'allocation pourra être en-dehors de la plage indiquée (meilleure dans 5% des cas, pire dans 5% des cas, sans que le montant de cette perte soit connu).



— Proposition

DÉTAIL DE LA PROPOSITION

Nom	Code ISIN	Poids	Montant
OBLIGATAIRE		**29 %**	**14 453 €**
BLUEBAY INV GR EUR AGG BDFD S-EUR	LU0995160461	15 %	7 503 €
OBLIGATIONS 5-7 M	FR0007033683	9 %	4 480 €
BLUEBAY INV GR EUR GOV BDFD C-EUR	LU0842209909	4,9 %	2 470 €
ALLOCATION D'ACTIFS		**20 %**	**10 017 €**
IDE DYNAMIC WORLD FLEXIBLE C	FR0011634377	15 %	7 503 €
TIKEHAU GLOBAL VALUE P	FR0012127389	5 %	2 514 €
ACTIONS		**51 %**	**25 531 €**
OSSIAM SHILLER BAR CAPE US SCT	LU1079841273	15 %	7 503 €
KIRAO RISTRETTO AC	FR0012739449	12 %	6 019 €
MC CONVICTIONS FRANCE	FR0010946632	10 %	4 996 €
JPM PACIFIC EQUITY A CAP EUR	LU0217390573	6 %	3 023 €
AA MMF LOOMIS US EQUITIES A EUR	LU0979881025	4,9 %	2 470 €
UBS (LUX) INST FD - EMG MKT EQ AA	LU0200130796	3 %	1 520 €
TOTAL		**100 %**	**50 001 €**

LISTE DES TRANSACTIONS

Valeurs à l'achat

OSSIAM SHILLER BAR CAPE US SCT	LU1079841273	EUR	7 503 €	14,99 %
IDE DYNAMIC WORLD FLEXIBLE C	FR0011634377	EUR	7 503 €	15,01 %
BLUEBAY INV GR EUR AGG BDFD S-EUR	LU0995160461	EUR	7 503 €	15,01 %
KIRAO RISTRETTO AC	FR0012739449	EUR	6 019 €	12,04 %
MC CONVICTIONS FRANCE	FR0010946632	EUR	4 996 €	9,99 %
OBLIGATIONS 5-7 M	FR0007033683	EUR	4 480 €	8,96 %
JPM PACIFIC EQUITY A CAP EUR	LU0217390573	EUR	3 023 €	6,05 %
TIKEHAU GLOBAL VALUE P	FR0012127389	EUR	2 514 €	5,03 %
AA MMF LOOMIS US EQUITIES A EUR	LU0979881025	EUR	2 470 €	4,94 %
BLUEBAY INV GR EUR GOV BDFD C-EUR	LU0842209909	EUR	2 470 €	4,94 %
UBS (LUX) INST FD - EMG MKT EQ AA	LU0200130796	USD	1 520 €	3,04 %
			50 001 €	

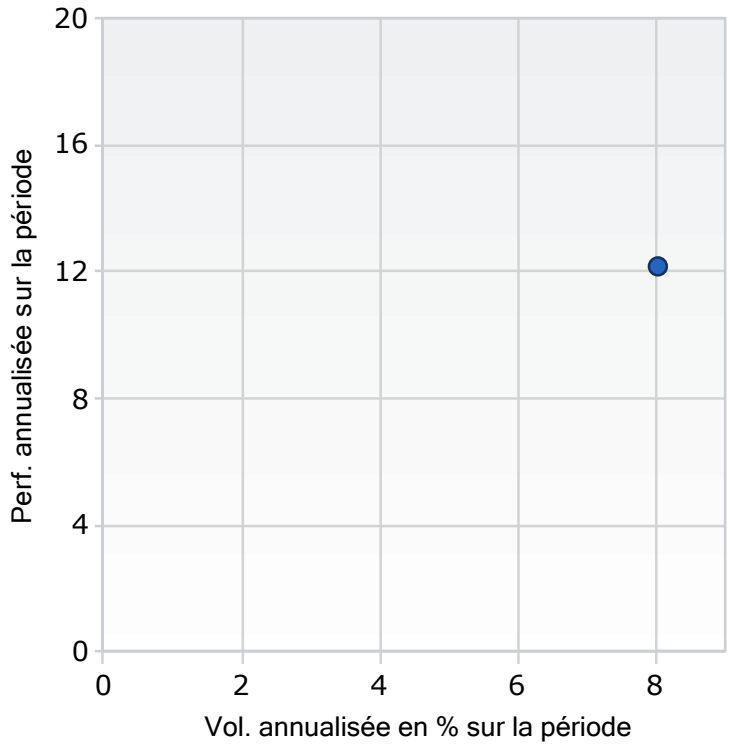
BACKTEST DE LA PROPOSITION DU 21/09/2015 (BASE 100) AU 20/09/2018

Nom	Perf. cumulée	Perf. annualisée	Volatilité	Sharpe	Perte max
Proposition	41,15%	12,16%	8,02%	1,56	-9,34%

Analyse du portefeuille Proposition du 21/09/2015 au 20/09/2018

Nom	Poids	Perf. cumulée	Perf. annualisée	Volatilité	Sharpe	Perte max	CVar
AA MMF LOOMIS US EQUITIES A EUR	4,9%	62,39%	17,52%	16,04%	1,11	-20,83%	-3,22%
BLUEBAY INV GR EUR AGG BDFD S-EUR	15,0%	13,23%	4,23%	3,43%	1,33	-3,51%	-0,70%
BLUEBAY INV GR EUR GOV BDFD C-EUR	4,9%	6,25%	2,04%	2,69%	0,88	-2,29%	-0,74%
IDE DYNAMIC WORLD FLEXIBLE C	15,0%	41,88%	12,35%	13,36%	0,95	-18,51%	-3,48%
JPM PACIFIC EQUITY A CAP EUR	6,0%	46,62%	13,59%	14,54%	0,96	-21,47%	-2,50%
KIRAO RISTRETTO AC	12,0%	65,52%	18,27%	10,13%	1,84	-6,45%	-3,00%
MC CONVICTIONS FRANCE	10,0%	43,70%	12,83%	12,14%	1,08	-13,86%	-2,33%
OBLIGATIONS 5-7 M	9,0%	18,58%	5,84%	3,65%	1,69	-5,79%	-0,66%
OSSIAM SHILLER BAR CAPE US SCT	15,0%	66,18%	18,43%	14,38%	1,30	-14,97%	-3,07%
TIKEHAU GLOBAL VALUE P	5,0%	28,46%	8,70%	7,73%	1,17	-7,42%	-1,27%
UBS (LUX) INST FD - EMG MKT EQ AA	3,0%	45,85%	13,39%	16,73%	0,82	-19,92%	-2,66%

Comparaison Rendement / Risque



SYNTHESE DE LA PROPOSITION

Pour un investissement de 50 000 euros sur une période de 15 ans avec un profil de risque "Prudent", vous avez choisi une allocation d'actifs composée à 20% de flexibles, 29% d'obligataire, 51% d'actions.

Vous avez choisi de construire un portefeuille en utilisant tous les fonds de la base de données Quantalys.
Ce portefeuille selon vos spécifications a un rendement moyen théorique de 5,82% par an, un risque annuel attendu de 9,49%. L'espérance de gain à 15 ans est de 119,91%, le gain minimal à 15 ans est de 24,32% et la perte maximale au cours des 15 ans est de 9,81% (ces données correspondent à un intervalle de confiance de 90% et ne sont pas garanties).

Cette construction de portefeuille a été faite le 26/09/2018 sur la base des données connues à cette date.

AVERTISSEMENT

Les informations contenues dans ce rapport appartiennent à Quantalys qui ne garantit ni leur fiabilité, ni leur exhaustivité. Ces informations sont fournies à titre indicatif exclusivement par la société Quantalys. Elle ne constitue pas de la part de Quantalys une offre d'achat, de vente, de souscription ou de services financiers, ni une sollicitation d'une offre d'achat de quelque produit d'investissement que ce soit. Lisez les conditions générales du contrat d'assurance vie et le prospectus ou les caractéristiques principales du fonds avant toute décision d'investissement. Les performances passées ne préjugent pas des performances futures.
Toutes les performances et données liées sont calculées en euro et ne sont pas garanties, notamment dans le cas de fonds libellés dans une devise différente de l'euro. Pour le calcul du ratio de Sharpe, Quantalys utilise l'EONIA pour représenter le taux sans risque.
Les rendements et risques attendus ne sont pas garantis et reposent sur des hypothèses de performance et volatilité futures des classes d'actifs, lesquelles hypothèses ne se vérifieront pas nécessairement. La perte maximum réellement encourue dans certains cas pendant la durée de l'investissement pourra être supérieure à la perte maximum calculée dans ce document, sans que son montant puisse être connu à l'avance.
Le calcul de performance future attendue de la proposition est fait avec un intervalle de confiance de 90%.

COMMENTAIRES DE VOTRE CONSEILLER

Rapport factice créé pour illustrer la prestation de création de portefeuille

SIGNATURE

CORRÉLATIONS À 3 ANS AU 20/09/2018

		1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11
1	AA MMF LOOMIS US EQUITIES A EUR	1,00										
2	BLUEBAY INV GR EUR AGG BDFD S-EUR	0,19	1,00									
3	BLUEBAY INV GR EUR GOV BDFD C-EUR	0,07	0,62	1,00								
4	IDE DYNAMIC WORLD FLEXIBLE C	0,89	0,19	0,07	1,00							
5	JPM PACIFIC EQUITY A CAP EUR	0,71	0,27	0,07	0,80	1,00						
6	KIRAO RISTRETTO AC	0,34	0,18	0,02	0,42	0,37	1,00					
7	MC CONVICTIONS FRANCE	0,62	0,20	0,06	0,74	0,68	0,55	1,00				
8	OBLIGATIONS 5-7 M	0,22	0,13	0,04	0,37	0,47	0,25	0,42	1,00			
9	OSSIAM SHILLER BAR CAPE US SCT	0,92	0,18	0,06	0,81	0,65	0,27	0,55	0,20	1,00		
10	TIKEHAU GLOBAL VALUE P	0,38	-0,06	-0,03	0,47	0,49	0,30	0,42	0,56	0,39	1,00	
11	UBS (LUX) INST FD - EMG MKT EQ AA	0,70	0,24	0,04	0,79	0,89	0,35	0,67	0,41	0,61	0,43	1,00

Vert : Bon potentiel de diversification (corrélation inférieure à 0,6)

Orange : Potentiel de diversification moyen (corrélation entre 0,6 et 0,9)

Rouge : Mauvais potentiel de diversification (corrélation supérieure à 0,9)

LISTE DES FONDS DU PORTEFEUILLE FINAL

Nom	ISIN	VL	Perf. YTD	Perf. 1A	Perf. 3A	Perf. 5A	Date Perf.*	Sharpe* 1A	Risque* 1A	Sharpe* 3A	Risque* 3A	Sharpe* 5A	Risque* 5A	Notation*
OBLIGATAIRE														
BLUEBAY INV GR EUR AGG BDFD S-EUR	LU0995160461	128,44 EUR	0,18	1,82	13,60	-	24/09/18	0,98	2,52	1,35	3,45	-	-	
BLUEBAY INV GR EUR GOV BDFD C-EUR	LU0842209909	104,24 EUR	0,64	2,23	6,43	-	24/09/18	0,85	2,97	0,91	2,71	-	-	
OBLIGATIONS 5-7 M	FR0007033683	1 105,72 EUR	0,11	1,85	18,58	38,49	20/09/18	0,82	2,42	1,65	3,63	2,18	3,23	
ALLOCATION D'ACTIFS														
IDE DYNAMIC WORLD FLEXIBLE C	FR0011634377	152,01 EUR	10,35	15,99	41,93	-	21/09/18	1,50	12,45	0,98	13,38	-	-	
TIKEHAU GLOBAL VALUE P	FR0012127389	642,71 EUR	3,86	8,83	28,54	-	21/09/18	1,90	6,23	1,21	7,71	-	-	
ACTIONS														
AA MMF LOOMIS US EQUITIES A EUR	LU0979881025	223,04 EUR	12,34	18,60	62,17	-	24/09/18	1,44	15,08	1,11	15,96	-	-	
JPM PACIFIC EQUITY A CAP EUR	LU0217390573	17,60 EUR	0,06	6,41	48,77	66,51	25/09/18	0,83	12,24	1,01	14,41	0,83	15,36	
KIRAO RISTRETTO AC	FR0012739449	183,08 EUR	2,34	5,41	66,22	-	21/09/18	1,24	8,50	1,89	10,08	-	-	
MC CONVICTIONS FRANCE	FR0010946632	266,19 EUR	-3,93	0,67	46,94	79,06	24/09/18	0,31	12,14	1,11	11,91	1,05	13,33	
OSSIAM SHILLER BAR CAPE US SCT	LU1079841273	596,15 EUR	15,13	21,85	66,17	-	24/09/18	1,58	13,58	1,26	14,34	-	-	
UBS (LUX) INST FD - EMG MKT EQ AA	LU0200130796	173,20 USD	-8,01	-1,54	50,63	51,46	24/09/18	0,05	14,15	0,89	16,65	0,62	17,07	

* La date mentionnée dans le tableau est celle de la dernière VL disponible et du calcul des performances cumulées depuis le début de l'année et sur 1, 3 et 5 ans. Les performances sont indiquées en pourcentage. Le ratio de Sharpe, le risque (qui correspond à la volatilité annualisée des rendements hebdomadaires) et la notation Quantalys sont calculés au 31/08/2018.
** Fonds non diagnostiqués

OSSIAM SHILLER BAR CAPE US SCT

powered by Quantalys

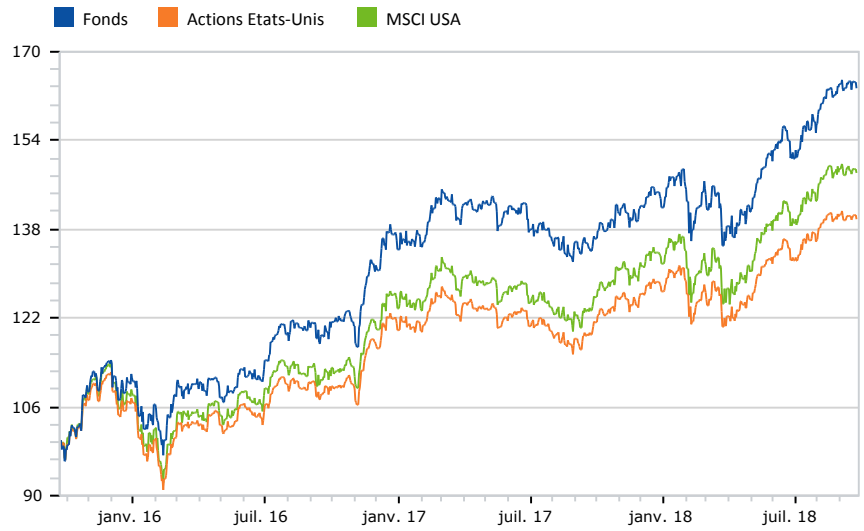
Fiche d'identité

Nom du fonds	OSSIAM SHILLER BAR CAPE US SCT
Société de gestion	Ossiam
Code ISIN	LU1079841273
Classification AMF	-
Indice de référence	SHILLER BARCLAYS CAPE® US SECTOR VALUE NET TR INDEX
Type d'investisseur	Tous souscripteurs
Catégorie Quantalys	Actions Etats-Unis
Indice de réf. Quantalys	MSCI USA

Notation Quantalys

VL 596,15 EUR
(24/09/2018)

Historique base 100 du 24/09/2015 au 24/09/2018



Performances

	Fonds	Catégorie
Performance au 24/09/2018		
Perf. veille	-0,66 %	0,00 %
Perf. 4 semaines	0,33 %	-0,33 %
Perf. 1er janvier	15,13 %	10,26 %
Perf. 1 an	21,85 %	17,46 %
Perf. 3 ans	66,17 %	41,67 %
Perf. 5 ans	-	-
Performance annuelles		
Perf. 2017	5,63 %	5,83 %
Perf. 2016	21,50 %	12,26 %
Perf. 2015	-	-
Données 3 ans au 31/08/2018		
Perf. ann.	17,80 %	11,56 %
Volatilité	14,34 %	12,99 %
Sharpe	1,26	0,91

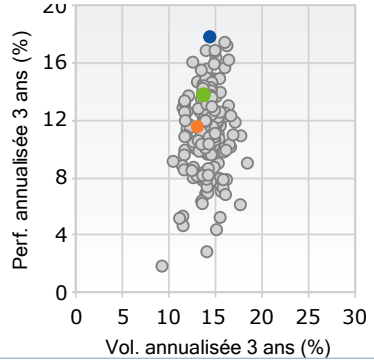
Comportement

Marché	Classement à 3 ans
Très haussier	Très bon
Haussier	Moyen
Neutre	Très bon
Baissier	Très bon
Très baissier	Très bon

Classement du fonds

	Rang		Quartile
1 mois	26	/ 336	1
3 mois	15	/ 334	1
6 mois	37	/ 330	1
YTD	24	/ 328	1
1 an	90	/ 320	2
3 ans	1	/ 264	1
5 ans	-		-

Fonds versus catégorie



Indicateurs généraux

Valeurs à 3 ans		Faible Fort
Perf. ann.	17,80 %	
Surperf. ann.	4,04 %	
Ecart de suivi	4,53 %	
Ratio d'info	0,89	
Beta	1,00	

Indicateurs de risque

Valeurs à 3 ans		Par rapport à la cat
Volatilité	14,34 %	Moyen
Perte max	-14,97 %	Très bon
DSR	9,34 %	Bon
Beta bais.	0,94	Moyen
VAR	-3,34 %	Moyen

Profil de risque DICI

A risque plus faible							A risque plus élevé
	1	2	3	4	**5**	6	7

Caractéristiques générales

Type	ETF
Capi/Distri	Capitalisation
Part couverte	Non
Eligible au PEA / PEA PME	Non / Non
Frais maximum	
Souscription	Courtage
Rachat	Courtage
Gestion	0,65 %
Surperformance	Néant
Courants	0,65 %
Actif au 24/09/2018	
Actif net de la part	425 M EUR
Actif net global	425 M EUR
Variation de l'actif 3 mois	17,47 %
Gérant	-

© 2018 Quantalys. Les informations contenues dans cette fiche appartiennent à Quantalys qui ne garantit ni leur fiabilité, ni leur exhaustivité. Cette fiche fonds vous est fournie à titre indicatif exclusivement par la société Quantalys. Elle ne constitue pas de la part de Quantalys une offre d'achat, de vente, de souscription ou de services financiers, ni une sollicitation d'une offre d'achat de quelque produit d'investissement que ce soit. Lisez le prospectus du fonds avant toute décision d'investissement. Les performances passées ne préjugent pas des performances futures.La notation Quantalys, les indicateurs, le comportement, la position du fonds par rapport à sa catégorie sont en date du 31/08/2018.Toutes les performances et données liées sont calculées en euro et ne sont pas garanties, notamment dans le cas de fonds libellés dans une devise différente de l'euro.

IDE DYNAMIC WORLD FLEXIBLE C

powered by Quantalys

Fiche d'identité

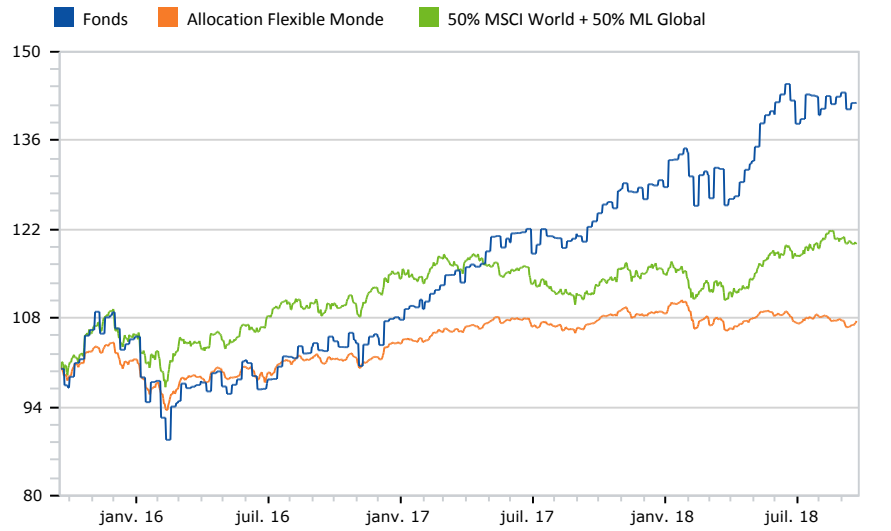
Nom du fonds	IDE DYNAMIC WORLD FLEXIBLE C
Société de gestion	Investisseurs dans l'entreprise AM
Code ISIN	FR0011634377
Classification AMF	
Indice de référence	75% du Footsie All World 20% de l'Euro MTS 3-5 ans
Type d'investisseur	Tous souscripteurs
Catégorie Quantalys	Allocation Flexible Monde
Indice de réf. Quantalys	50% MSCI World + 50% ML Global

Notation Quantalys

Tendance à 3 mois : Stable

VL 152,01 EUR
(21/09/2018)

Historique base 100 du 21/09/2015 au 21/09/2018



Performances

	Fonds	Catégorie
Performance au 21/09/2018		
Perf. veille	0,04 %	0,08 %
Perf. 4 semaines	-0,64 %	-0,09 %
Perf. 1er janvier	10,35 %	-1,09 %
Perf. 1 an	15,99 %	0,34 %
Perf. 3 ans	41,93 %	7,39 %
Perf. 5 ans	-	-
Performance annuelles		
Perf. 2017	19,41 %	4,58 %
Perf. 2016	2,51 %	2,45 %
Perf. 2015	9,48 %	3,31 %
Données 3 ans au 31/08/2018		
Perf. ann.	12,84 %	2,14 %
Volatilité	13,38 %	5,89 %
Sharpe	0,98	0,42

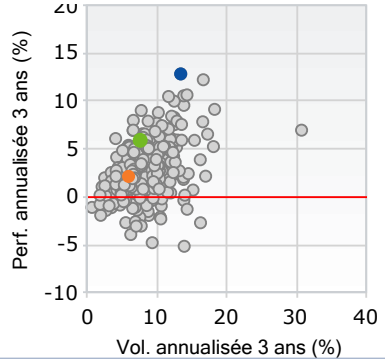
Comportement

Marché	Classement à 4 ans
Très haussier	Très bon
Haussier	Très bon
Neutre	Très bon
Baissier	Moyen
Très baissier	Très mauvais

Classement du fonds

	Rang		Quartile
1 mois	16	/ 974	1
3 mois	100	/ 961	1
6 mois	4	/ 930	1
YTD	8	/ 910	1
1 an	8	/ 863	1
3 ans	2	/ 694	1
5 ans	-		-

Fonds versus catégorie



Indicateurs généraux

Valeurs à 3 ans		Faible Fort
Perf. ann.	12,84 %	
Surperf. ann.	6,93 %	
Ecart de suivi	8,33 %	
Ratio d'info	0,83	
Beta	1,46	

Indicateurs de risque

Valeurs à 3 ans		Par rapport à la cat
Volatilité	13,38 %	Très mauvais
Perte max	-18,51 %	Très mauvais
DSR	9,33 %	Très mauvais
Beta bais.	1,78	Très mauvais
VAR	-3,27 %	Très mauvais

Profil de risque DICI

A risque plus faible							A risque plus élevé
	1	2	3	4	**5**	6	7

Caractéristiques générales

Type	SICAV
Capi/Distri	Capitalisation
Part couverte	Non
Eligible au PEA / PEA PME	Non / Non
Frais maximum	
Souscription	3 %
Rachat	Néant
Gestion	1,95 %
Surperformance	Oui
Courants	1,2 %
Actif au 21/09/2018	
Actif net de la part	87 M EUR
Actif net global	88 M EUR
Variation de l'actif 3 mois	-0,11 %
Gérant	Gestion collégiale

© 2018 Quantalys. Les informations contenues dans cette fiche appartiennent à Quantalys qui ne garantit ni leur fiabilité, ni leur exhaustivité. Cette fiche fonds vous est fournie à titre indicatif exclusivement par la société Quantalys. Elle ne constitue pas de la part de Quantalys une offre d'achat, de vente, de souscription ou de services financiers, ni une sollicitation d'une offre d'achat de quelque produit d'investissement que ce soit. Lisez le prospectus du fonds avant toute décision d'investissement. Les performances passées ne préjugent pas des performances futures.La notation Quantalys, les indicateurs, le comportement, la position du fonds par rapport à sa catégorie sont en date du 31/08/2018.Toutes les performances et données liées sont calculées en euro et ne sont pas garanties, notamment dans le cas de fonds libellés dans une devise différente de l'euro.

BLUEBAY INV GR EUR AGG BDFD S-EUR

powered by Quantalys

Fiche d'identité

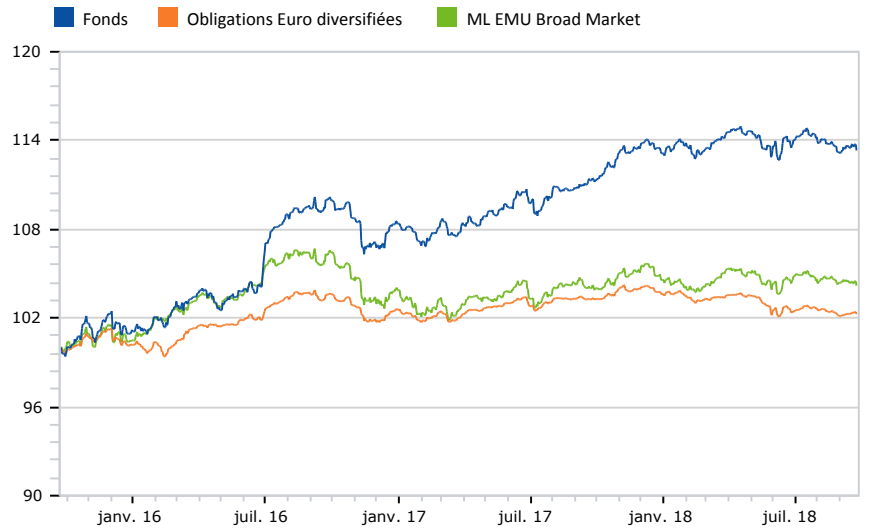
Nom du fonds	BLUEBAY INV GR EUR AGG BDFD S-EUR
Société de gestion	BlueBay Asset Management plc
Code ISIN	LU0995160461
Classification AMF	-
Indice de référence	Bloomberg Barclays Euro Aggregate Index
Type d'investisseur	Tous souscripteurs
Catégorie Quantalys	Obligations Euro diversifiées
Indice de réf. Quantalys	ML EMU Broad Market

Notation Quantalys

Tendance à 3 mois : Stable

VL 128,44 EUR
(24/09/2018)

Historique base 100 du 24/09/2015 au 24/09/2018



Performances

	Fonds	Catégorie
Performance au 24/09/2018		
Perf. veille	-0,36 %	0,00 %
Perf. 4 semaines	-0,26 %	-0,05 %
Perf. 1er janvier	0,18 %	-1,29 %
Perf. 1 an	1,82 %	-0,96 %
Perf. 3 ans	13,60 %	2,37 %
Perf. 5 ans	-	-
Performance annuelles		
Perf. 2017	4,38 %	1,03 %
Perf. 2016	7,20 %	2,35 %
Perf. 2015	-	-
Données 3 ans au 31/08/2018		
Perf. ann.	4,33 %	0,75 %
Volatilité	3,45 %	1,73 %
Sharpe	1,35	0,62

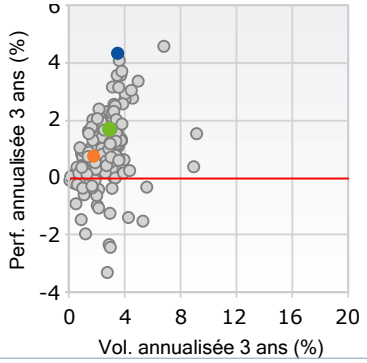
Comportement

Marché	Classement à 3 ans
Très haussier	
Haussier	Très bon
Neutre	Très bon
Baissier	Mauvais
Très baissier	

Classement du fonds

	Rang		Quartile
1 mois	243	/ 296	4
3 mois	180	/ 292	3
6 mois	55	/ 292	1
YTD	20	/ 291	1
1 an	6	/ 289	1
3 ans	2	/ 262	1
5 ans	-		-

Fonds versus catégorie



Indicateurs généraux

Valeurs à 3 ans		Faible Fort
Perf. ann.	4,33 %	
Surperf. ann.	2,63 %	
Ecart de suivi	1,92 %	
Ratio d'info	1,37	
Beta	1,00	

Indicateurs de risque

Valeurs à 3 ans		Par rapport à la cat
Volatilité	3,45 %	Très mauvais
Perte max	-3,51 %	Bon
DSR	2,09 %	Mauvais
Beta bais.	0,91	Très mauvais
VAR	-0,70 %	Mauvais

Profil de risque DICI

A risque plus faible							A risque plus élevé
	1	2	**3**	4	5	6	7

Caractéristiques générales

Type	SICAV
Capi/Distri	Capitalisation
Part couverte	Non
Eligible au PEA / PEA PME	Non / Non
Frais maximum	
Souscription	5 %
Rachat	Néant
Gestion	2 %
Surperformance	Néant
Courants	0,36 %
Actif au 04/08/2015	
Actif net de la part	27 M EUR
Actif net global	1 295 M EUR
Variation de l'actif 3 mois	4,14 %
Gérant	Gestion collégiale

© 2018 Quantalys. Les informations contenues dans cette fiche appartiennent à Quantalys qui ne garantit ni leur fiabilité, ni leur exhaustivité. Cette fiche fonds vous est fournie à titre indicatif exclusivement par la société Quantalys. Elle ne constitue pas de la part de Quantalys une offre d'achat, de vente, de souscription ou de services financiers, ni une sollicitation d'une offre d'achat de quelque produit d'investissement que ce soit. Lisez le prospectus du fonds avant toute décision d'investissement. Les performances passées ne préjugent pas des performances futures.La notation Quantalys, les indicateurs, le comportement, la position du fonds par rapport à sa catégorie sont en date du 31/08/2018.Toutes les performances et données liées sont calculées en euro et ne sont pas garanties, notamment dans le cas de fonds libellés dans une devise différente de l'euro.

KIRAO RISTRETTO AC

powered by Quantalys

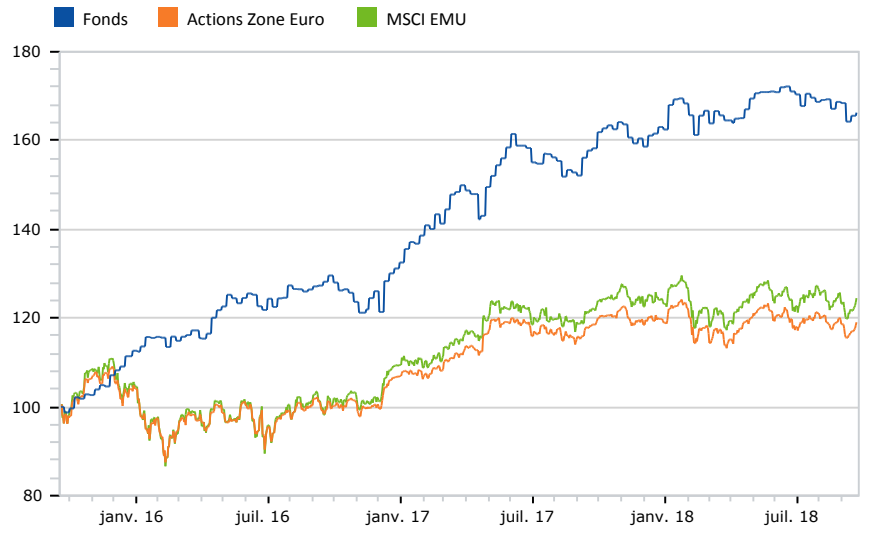
Fiche d'identité

Nom du fonds	KIRAO RISTRETTO AC
Société de gestion	Kirao
Code ISIN	FR0012739449
Classification AMF	Actions de pays de la zone euro
Indice de référence	
Type d'investisseur	Tous souscripteurs
Catégorie Quantalys	Actions Zone Euro
Indice de réf. Quantalys	MSCI EMU

Notation Quantalys

VL 183,08 EUR
(21/09/2018)

Historique base 100 du 21/09/2015 au 21/09/2018



Performances

	Fonds	Catégorie
Performance au 21/09/2018		
Perf. veille	0,43 %	0,60 %
Perf. 4 semaines	-1,44 %	-0,02 %
Perf. 1er janvier	2,34 %	0,10 %
Perf. 1 an	5,41 %	0,55 %
Perf. 3 ans	66,22 %	18,42 %
Perf. 5 ans	-	-
Performance annuelles		
Perf. 2017	22,58 %	11,18 %
Perf. 2016	17,65 %	2,78 %
Perf. 2015	-	-
Données 3 ans au 31/08/2018		
Perf. ann.	18,72 %	5,03 %
Volatilité	10,08 %	13,11 %
Sharpe	1,89	0,41

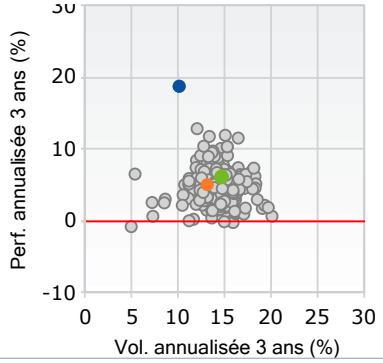
Comportement

Marché	Classement à 3 ans
Très haussier	Mauvais
Haussier	Moyen
Neutre	Très bon
Baissier	Très bon
Très baissier	Très bon

Classement du fonds

	Rang		Quartile
1 mois	69	/ 353	1
3 mois	163	/ 351	2
6 mois	217	/ 347	3
YTD	30	/ 347	1
1 an	15	/ 342	1
3 ans	1	/ 311	1
5 ans	-		-

Fonds versus catégorie



Indicateurs généraux

Valeurs à 3 ans		Faible Fort
Perf. ann.	18,72 %	
Surperf. ann.	12,60 %	
Ecart de suivi	13,02 %	
Ratio d'info	0,97	
Beta	0,34	

Indicateurs de risque

Valeurs à 3 ans		Par rapport à la cat
Volatilité	10,08 %	Très bon
Perte max	-6,45 %	Très bon
DSR	5,64 %	Très bon
Beta bais.	0,12	Très bon
VAR	-1,82 %	Très bon

Profil de risque DICI

A risque plus faible							A risque plus élevé
	1	2	3	4	5	6	7

Caractéristiques générales

Type	FCP
Capi/Distri	Capitalisation
Part couverte	Non
Eligible au PEA / PEA PME	Non / Non
Autre	FIA
Frais maximum	
Souscription	3 %
Rachat	2 %
Gestion	2,35 %
Surperformance	Néant
Courants	-
Actif au 21/09/2018	
Actif net de la part	23 M EUR
Actif net global	23 M EUR
Variation de l'actif 3 mois	-1,78 %
Gérant	-

© 2018 Quantalys. Les informations contenues dans cette fiche appartiennent à Quantalys qui ne garantit ni leur fiabilité, ni leur exhaustivité. Cette fiche fonds vous est fournie à titre indicatif exclusivement par la société Quantalys. Elle ne constitue pas de la part de Quantalys une offre d'achat, de vente, de souscription ou de services financiers, ni une sollicitation d'une offre d'achat de quelque produit d'investissement que ce soit. Lisez le prospectus du fonds avant toute décision d'investissement. Les performances passées ne préjugent pas des performances futures.La notation Quantalys, les indicateurs, le comportement, la position du fonds par rapport à sa catégorie sont en date du 31/08/2018.Toutes les performances et données liées sont calculées en euro et ne sont pas garanties, notamment dans le cas de fonds libellés dans une devise différente de l'euro.

MC CONVICTIONS FRANCE

powered by Quantalys

Fiche d'identité

Nom du fonds	MC CONVICTIONS FRANCE
Société de gestion	Montaigne Capital
Code ISIN	FR0010946632
Classification AMF	Actions des pays de l'Union Européenne
Indice de référence	CAC All tradable net (dividendes net réinvestis)
Type d'investisseur	Tous souscripteurs
Catégorie Quantalys	Actions France
Indice de réf. Quantalys	MSCI France

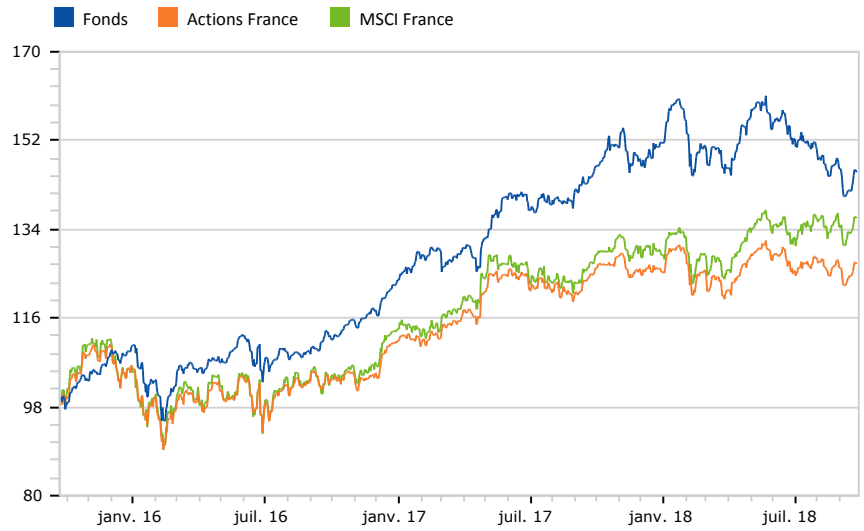
Notation Quantalys

★★★★★

Tendance à 3 mois : Stable

VL 266,19 EUR
(24/09/2018)

Historique base 100 du 24/09/2015 au 24/09/2018



Performances

	Fonds	Catégorie
Performance au 24/09/2018		
Perf. veille	-0,32 %	0,01 %
Perf. 4 semaines	-1,74 %	-0,51 %
Perf. 1er janvier	-3,93 %	1,30 %
Perf. 1 an	0,67 %	1,62 %
Perf. 3 ans	46,94 %	28,91 %
Perf. 5 ans	79,06 %	43,59 %
Performance annuelles		
Perf. 2017	22,46 %	12,47 %
Perf. 2016	11,93 %	5,46 %
Perf. 2015	23,16 %	13,29 %
Données 3 ans au 31/08/2018		
Perf. ann.	12,88 %	6,48 %
Volatilité	11,91 %	13,87 %
Sharpe	1,11	0,49

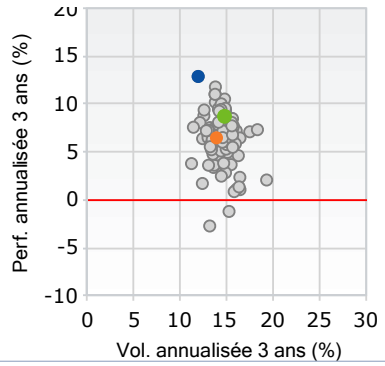
Comportement

Marché	Classement à 5 ans
Très haussier	Très mauvais
Haussier	Très bon
Neutre	Très bon
Baissier	Très bon
Très baissier	Bon

Classement du fonds

	Rang		Quartile
1 mois	88	/ 114	4
3 mois	110	/ 113	4
6 mois	98	/ 113	4
YTD	96	/ 113	4
1 an	77	/ 111	3
3 ans	1	/ 107	1
5 ans	1	/ 103	1

Fonds versus catégorie



Indicateurs généraux

Valeurs à 3 ans		Faible Fort
Perf. ann.	12,88 %	
Surperf. ann.	4,15 %	
Ecart de suivi	9,90 %	
Ratio d'info	0,42	
Beta	0,60	

Indicateurs de risque

Valeurs à 3 ans		Par rapport à la cat
Volatilité	11,91 %	Très bon
Perte max	-13,86 %	Très bon
DSR	7,97 %	Très bon
Beta bais.	0,71	Très bon
VAR	-2,66 %	Très bon

Profil de risque DICI

A risque plus faible							A risque plus élevé
	1	2	3	4	**5**	6	7

Caractéristiques générales

Type	FCP
Capi/Distri	Capitalisation
Part couverte	Non
Eligible au PEA / PEA PME	Oui / Non
Frais maximum	
Souscription	2 %
Rachat	Néant
Gestion	1,8 %
Surperformance	Néant
Courants	2,5 %
Actif au 24/09/2018	
Actif net de la part	15 M EUR
Actif net global	15 M EUR
Variation de l'actif 3 mois	-2,19 %
Gérant	Jérôme Guilmard

© 2018 Quantalys. Les informations contenues dans cette fiche appartiennent à Quantalys qui ne garantit ni leur fiabilité, ni leur exhaustivité. Cette fiche fonds vous est fournie à titre indicatif exclusivement par la société Quantalys. Elle ne constitue pas de la part de Quantalys une offre d'achat, de vente, de souscription ou de services financiers, ni une sollicitation d'une offre d'achat de quelque produit d'investissement que ce soit. Lisez le prospectus du fonds avant toute décision d'investissement. Les performances passées ne préjugent pas des performances futures.La notation Quantalys, les indicateurs, le comportement, la position du fonds par rapport à sa catégorie sont en date du 31/08/2018.Toutes les performances et données liées sont calculées en euro et ne sont pas garanties, notamment dans le cas de fonds libellés dans une devise différente de l'euro.

OBLIGATIONS 5-7 M

powered by Quantalys

Fiche d'identité

Nom du fonds	OBLIGATIONS 5-7 M
Société de gestion	Aviva Investors France
Code ISIN	FR0007033683
Classification AMF	Obligations et/ou titres de créances internationaux
Indice de référence	JP Morgan Global Government Bond H
Type d'investisseur	Tous souscripteurs
Catégorie Quantalys	Obligations Monde diversifiées
Indice de réf. Quantalys	ML Global Broad Market

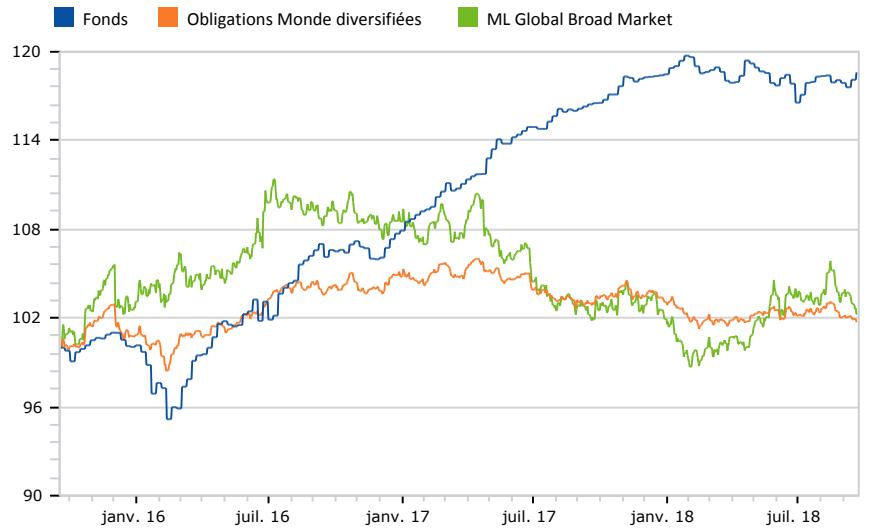
Notation Quantalys

★★★★★

Tendance à 3 mois : Stable

VL 1 105,72 EUR
(20/09/2018)

Historique base 100 du 20/09/2015 au 20/09/2018



Performances

	Fonds	Catégorie
Performance au 20/09/2018		
Perf. veille	0,42 %	0,05 %
Perf. 4 semaines	0,44 %	-0,78 %
Perf. 1er janvier	0,11 %	-1,31 %
Perf. 1 an	1,85 %	-1,10 %
Perf. 3 ans	18,58 %	1,72 %
Perf. 5 ans	38,49 %	12,52 %
Performance annuelles		
Perf. 2017	9,78 %	-1,64 %
Perf. 2016	7,74 %	3,88 %
Perf. 2015	2,31 %	2,80 %
Données 3 ans au 31/08/2018		
Perf. ann.	5,66 %	0,53 %
Volatilité	3,63 %	2,74 %
Sharpe	1,65	0,31

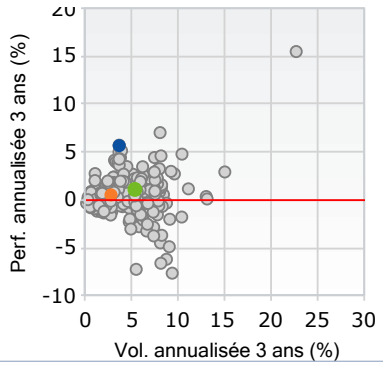
Comportement

Marché	Classement à 5 ans
Très haussier	Moyen
Haussier	Mauvais
Neutre	Très bon
Baissier	Très bon
Très baissier	Très bon

Classement du fonds

	Rang		Quartile
1 mois	297	/ 583	3
3 mois	147	/ 581	2
6 mois	317	/ 572	3
YTD	219	/ 564	2
1 an	55	/ 541	1
3 ans	4	/ 418	1
5 ans	6	/ 305	1

Fonds versus catégorie



Indicateurs généraux

Valeurs à 3 ans		Faible Fort
Perf. ann.	5,66 %	
Surperf. ann.	4,57 %	
Ecart de suivi	6,67 %	
Ratio d'info	0,69	
Beta	-0,06	

Indicateurs de risque

Valeurs à 3 ans		Par rapport à la cat
Volatilité	3,63 %	Moyen
Perte max	-5,79 %	Bon
DSR	2,47 %	Moyen
Beta bais.	-0,18	Très bon
VAR	-0,72 %	Moyen

Profil de risque DICI

A risque plus faible							A risque plus élevé
	1	2	**3**	4	5	6	7

Caractéristiques générales

Type	FCP
Capi/Distri	Capitalisation ou Distribution
Part couverte	Non
Eligible au PEA / PEA PME	Non / Non
Frais maximum	
Souscription	5 %
Rachat	Néant
Gestion	0,5 %
Surperformance	Néant
Courants	0,51 %
Actif au 20/09/2018	
Actif net de la part	240 M EUR
Actif net global	240 M EUR
Variation de l'actif 3 mois	-0,24 %
Gérant	Paul Gagey

© 2018 Quantalys. Les informations contenues dans cette fiche appartiennent à Quantalys qui ne garantit ni leur fiabilité, ni leur exhaustivité. Cette fiche fonds vous est fournie à titre indicatif exclusivement par la société Quantalys. Elle ne constitue pas de la part de Quantalys une offre d'achat, de vente, de souscription ou de services financiers, ni une sollicitation d'une offre d'achat de quelque produit d'investissement que ce soit. Lisez le prospectus du fonds avant toute décision d'investissement. Les performances passées ne préjugent pas des performances futures.La notation Quantalys, les indicateurs, le comportement, la position du fonds par rapport à sa catégorie sont en date du 31/08/2018.Toutes les performances et données liées sont calculées en euro et ne sont pas garanties, notamment dans le cas de fonds libellés dans une devise différente de l'euro.

JPM PACIFIC EQUITY A CAP EUR

powered by Quantalys

Fiche d'identité

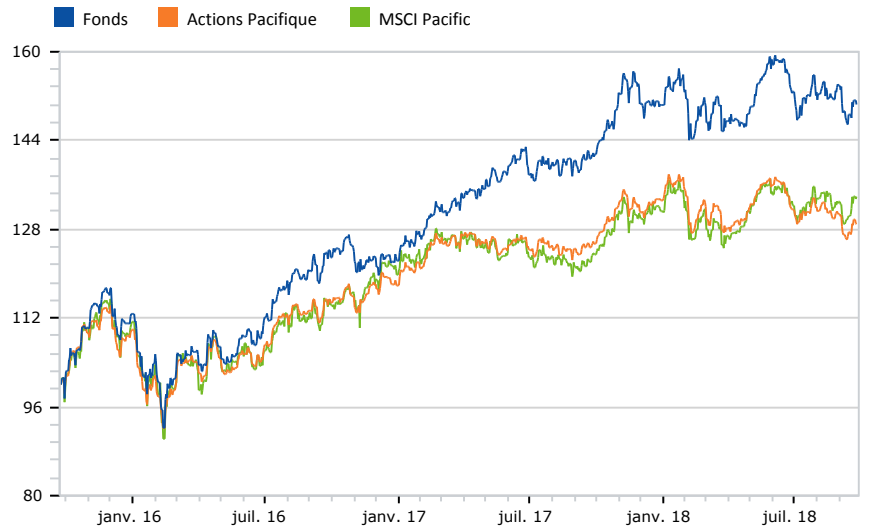
Nom du fonds	JPM PACIFIC EQUITY A CAP EUR
Société de gestion	JPMorgan Asset Management
Code ISIN	LU0217390573
Classification AMF	-
Indice de référence	MSCI All Country Asia Pacific Index (Total Return Net)
Type d'investisseur	Tous souscripteurs
Catégorie Quantalys	Actions Pacifique
Indice de réf. Quantalys	MSCI Pacific

Notation Quantalys

Tendance à 3 mois : Stable

VL 17,60 EUR
(25/09/2018)

Historique base 100 du 25/09/2015 au 25/09/2018



Performances

	Fonds	Catégorie
Performance au 25/09/2018		
Perf. veille	-0,51 %	-0,55 %
Perf. 4 semaines	-1,46 %	-1,46 %
Perf. 1er janvier	0,06 %	-3,19 %
Perf. 1 an	6,41 %	3,07 %
Perf. 3 ans	48,77 %	27,82 %
Perf. 5 ans	66,51 %	40,51 %
Performance annuelles		
Perf. 2017	22,92 %	13,02 %
Perf. 2016	8,49 %	7,21 %
Perf. 2015	16,11 %	7,98 %
Données 3 ans au 31/08/2018		
Perf. ann.	14,19 %	8,04 %
Volatilité	14,41 %	13,11 %
Sharpe	1,01	0,64

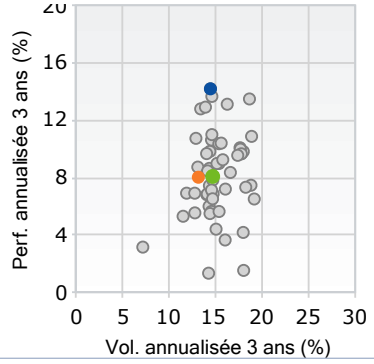
Comportement

Marché	Classement à 5 ans
Très haussier	Très bon
Haussier	Très bon
Neutre	Bon
Baissier	Mauvais
Très baissier	Très bon

Classement du fonds

	Rang	Quartile
1 mois	4 / 84	1
3 mois	30 / 84	2
6 mois	12 / 84	1
YTD	7 / 84	1
1 an	9 / 84	1
3 ans	1 / 77	1
5 ans	1 / 66	1

Fonds versus catégorie



Indicateurs généraux

Valeurs à 3 ans		Faible Fort
Perf. ann.	14,19 %	
Surperf. ann.	6,09 %	
Ecart de suivi	7,31 %	
Ratio d'info	0,83	
Beta	0,86	

Indicateurs de risque

Valeurs à 3 ans		Par rapport à la cat
Volatilité	14,41 %	Moyen
Perte max	-21,47 %	Mauvais
DSR	9,99 %	Moyen
Beta bais.	1,01	Très mauvais
VAR	-3,21 %	Bon

Profil de risque DICI

A risque plus faible							A risque plus élevé
	1	2	3	4	5	**6**	7

Caractéristiques générales

Type	SICAV
Capi/Distri	Capitalisation
Part couverte	Non
Eligible au PEA / PEA PME	Non / Non
Frais maximum	
Souscription	5 %
Rachat	0,5 %
Gestion	1,5 %
Surperformance	Néant
Courants	1,8 %
Actif au 25/09/2018	
Actif net de la part	72 M EUR
Actif net global	671 M EUR
Variation de l'actif 3 mois	-4,73 %
Gérant	Gestion collégiale

© 2018 Quantalys. Les informations contenues dans cette fiche appartiennent à Quantalys qui ne garantit ni leur fiabilité, ni leur exhaustivité. Cette fiche fonds vous est fournie à titre indicatif exclusivement par la société Quantalys. Elle ne constitue pas de la part de Quantalys une offre d'achat, de vente, de souscription ou de services financiers, ni une sollicitation d'une offre d'achat de quelque produit d'investissement que ce soit. Lisez le prospectus du fonds avant toute décision d'investissement. Les performances passées ne préjugent pas des performances futures.La notation Quantalys, les indicateurs, le comportement, la position du fonds par rapport à sa catégorie sont en date du 31/08/2018.Toutes les performances et données liées sont calculées en euro et ne sont pas garanties, notamment dans le cas de fonds libellés dans une devise différente de l'euro.

TIKEHAU GLOBAL VALUE P

powered by Quantalys

Fiche d'identité

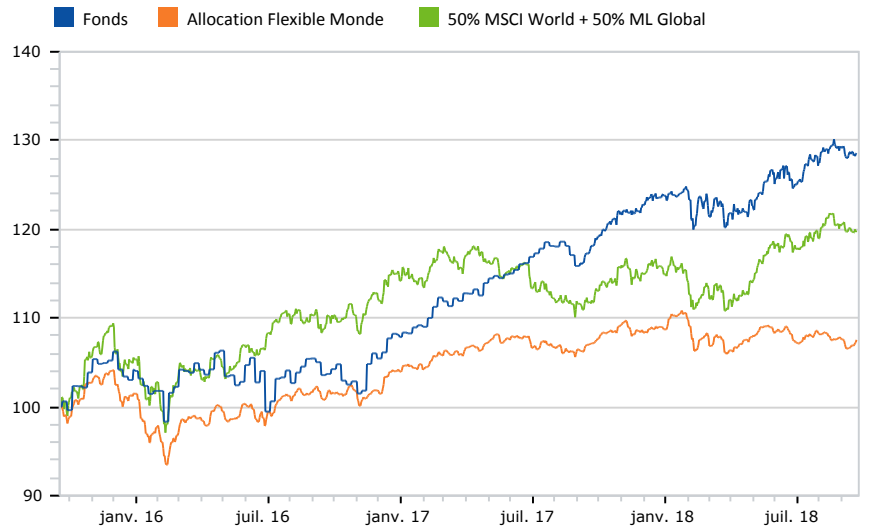
Nom du fonds	TIKEHAU GLOBAL VALUE P
Société de gestion	Tikehau Investment Management
Code ISIN	FR0012127389
Classification AMF	Actions internationales
Indice de référence	50% S&P500 EUR Hedged Net Total Return + 50% Stoxx 600 ...
Type d'investisseur	Tous souscripteurs
Catégorie Quantalys	Allocation Flexible Monde
Indice de réf. Quantalys	50% MSCI World + 50% ML Global

Notation Quantalys

Tendance à 3 mois : Stable

VL 642,71 EUR
(21/09/2018)

Historique base 100 du 21/09/2015 au 21/09/2018



Performances

	Fonds	Catégorie
Performance au 21/09/2018		
Perf. veille	0,06 %	0,08 %
Perf. 4 semaines	-0,46 %	-0,09 %
Perf. 1er janvier	3,86 %	-1,09 %
Perf. 1 an	8,83 %	0,34 %
Perf. 3 ans	28,54 %	7,39 %
Perf. 5 ans	-	-
Performance annuelles		
Perf. 2017	14,76 %	4,58 %
Perf. 2016	3,66 %	2,45 %
Perf. 2015	3,05 %	3,31 %
Données 3 ans au 31/08/2018		
Perf. ann.	9,01 %	2,14 %
Volatilité	7,71 %	5,89 %
Sharpe	1,21	0,42

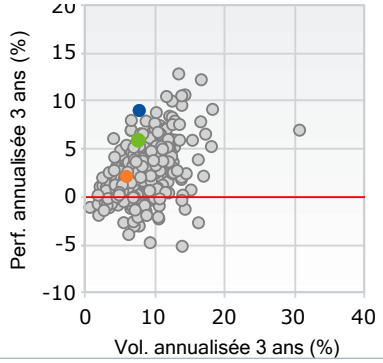
Comportement

Marché	Classement à 3 ans
Très haussier	Bon
Haussier	Très bon
Neutre	Très bon
Baissier	Très bon
Très baissier	Moyen

Classement du fonds

	Rang		Quartile
1 mois	141	/ 974	1
3 mois	20	/ 961	1
6 mois	60	/ 930	1
YTD	38	/ 910	1
1 an	17	/ 863	1
3 ans	14	/ 694	1
5 ans	-		-

Fonds versus catégorie



Indicateurs généraux

Valeurs à 3 ans		Faible Fort
Perf. ann.	9,01 %	
Surperf. ann.	3,10 %	
Ecart de suivi	8,48 %	
Ratio d'info	0,37	
Beta	0,39	

Indicateurs de risque

Valeurs à 3 ans		Par rapport à la cat
Volatilité	7,71 %	Moyen
Perte max	-7,42 %	Bon
DSR	5,29 %	Moyen
Beta bais.	0,30	Très bon
VAR	-1,76 %	Moyen

Profil de risque DICI

A risque plus faible							A risque plus élevé
	1	2	3	4	**5**	6	7

Caractéristiques générales

Type	FCP
Capi/Distri	Capitalisation
Part couverte	Non
Eligible au PEA / PEA PME	Non / Non
Frais maximum	
Souscription	3 %
Rachat	Néant
Gestion	1,8 %
Surperformance	Oui
Courants	2,18 %
Actif au 21/09/2018	
Actif net de la part	4 M EUR
Actif net global	18 M EUR
Variation de l'actif 3 mois	6,37 %
Gérant	Vincent Mercadier et Roma.

© 2018 Quantalys. Les informations contenues dans cette fiche appartiennent à Quantalys qui ne garantit ni leur fiabilité, ni leur exhaustivité. Cette fiche fonds vous est fournie à titre indicatif exclusivement par la société Quantalys. Elle ne constitue pas de la part de Quantalys une offre d'achat, de vente, de souscription ou de services financiers, ni une sollicitation d'une offre d'achat de quelque produit d'investissement que ce soit. Lisez le prospectus du fonds avant toute décision d'investissement. Les performances passées ne préjugent pas des performances futures.La notation Quantalys, les indicateurs, le comportement, la position du fonds par rapport à sa catégorie sont en date du 31/08/2018.Toutes les performances et données liées sont calculées en euro et ne sont pas garanties, notamment dans le cas de fonds libellés dans une devise différente de l'euro.

AA MMF LOOMIS US EQUITIES A EUR

powered by Quantalys

Fiche d'identité

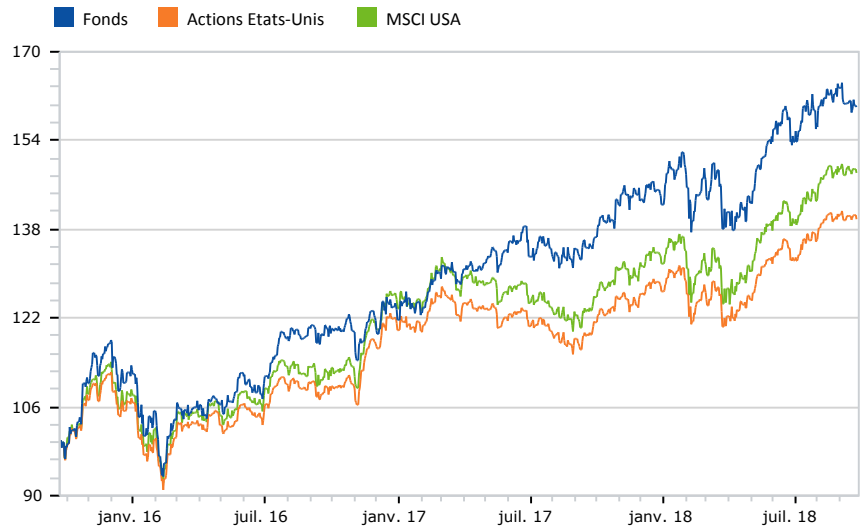
Nom du fonds	AA MMF LOOMIS US EQUITIES A EUR
Société de gestion	ABN AMRO Investment Solutions
Code ISIN	LU0979881025
Classification AMF	-
Indice de référence	MSCI USA TR
Type d'investisseur	Tous souscripteurs
Catégorie Quantalys	Actions Etats-Unis
Indice de réf. Quantalys	MSCI USA

Notation Quantalys

Tendance à 3 mois : Stable

VL 223,04 EUR
(24/09/2018)

Historique base 100 du 24/09/2015 au 24/09/2018



Performances

	Fonds	Catégorie
Performance au 24/09/2018		
Perf. veille	-0,17 %	0,00 %
Perf. 4 semaines	-2,07 %	-0,33 %
Perf. 1er janvier	12,34 %	10,26 %
Perf. 1 an	18,60 %	17,46 %
Perf. 3 ans	62,17 %	41,67 %
Perf. 5 ans	-	-
Performance annuelles		
Perf. 2017	17,05 %	5,83 %
Perf. 2016	8,74 %	12,26 %
Perf. 2015	23,05 %	9,61 %
Données 3 ans au 31/08/2018		
Perf. ann.	17,42 %	11,56 %
Volatilité	15,96 %	12,99 %
Sharpe	1,11	0,91

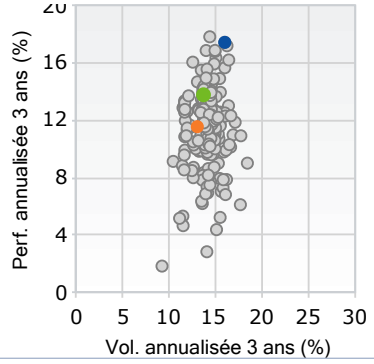
Comportement

Marché	Classement à 4 ans
Très haussier	Très bon
Haussier	Très mauvais
Neutre	Moyen
Baissier	Très bon
Très baissier	Moyen

Classement du fonds

	Rang		Quartile
1 mois	95	/ 336	2
3 mois	266	/ 334	4
6 mois	155	/ 330	2
YTD	30	/ 328	1
1 an	77	/ 320	1
3 ans	2	/ 264	1
5 ans	-		-

Fonds versus catégorie



Indicateurs généraux

Valeurs à 3 ans		Faible Fort
Perf. ann.	17,42 %	
Surperf. ann.	3,65 %	
Ecart de suivi	6,01 %	
Ratio d'info	0,61	
Beta	1,09	

Indicateurs de risque

Valeurs à 3 ans		Par rapport à la cat
Volatilité	15,96 %	Très mauvais
Perte max	-20,83 %	Mauvais
DSR	11,05 %	Très mauvais
Beta bais.	1,20	Très mauvais
VAR	-3,93 %	Très mauvais

Profil de risque DICI

A risque plus faible							A risque plus élevé
	1	2	3	4	**5**	6	7

Caractéristiques générales

Type	SICAV
Capi/Distri	Capitalisation
Part couverte	Non
Eligible au PEA / PEA PME	Non / Non
Frais maximum	
Souscription	5 %
Rachat	1 %
Gestion	1,5 %
Surperformance	Néant
Courants	1,7 %
Actif au 24/09/2018	
Actif net de la part	24 M EUR
Actif net global	24 M EUR
Variation de l'actif 3 mois	3,44 %
Gérant	Giovanni Becchere

© 2018 Quantalys. Les informations contenues dans cette fiche appartiennent à Quantalys qui ne garantit ni leur fiabilité, ni leur exhaustivité. Cette fiche fonds vous est fournie à titre indicatif exclusivement par la société Quantalys. Elle ne constitue pas de la part de Quantalys une offre d'achat, de vente, de souscription ou de services financiers, ni une sollicitation d'une offre d'achat de quelque produit d'investissement que ce soit. Lisez le prospectus du fonds avant toute décision d'investissement. Les performances passées ne préjugent pas des performances futures.La notation Quantalys, les indicateurs, le comportement, la position du fonds par rapport à sa catégorie sont en date du 31/08/2018.Toutes les performances et données liées sont calculées en euro et ne sont pas garanties, notamment dans le cas de fonds libellés dans une devise différente de l'euro.

BLUEBAY INV GR EUR GOV BDFD C-EUR

powered by Quantalys

Fiche d'identité

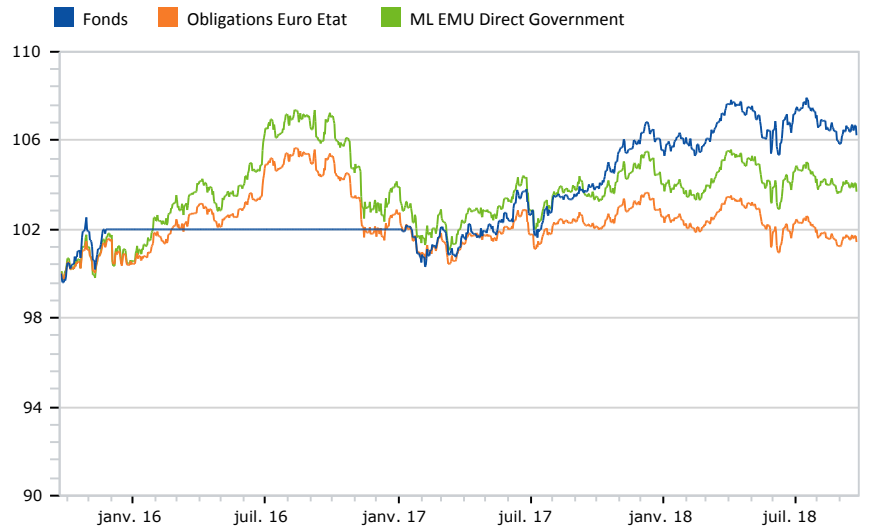
Nom du fonds	BLUEBAY INV GR EUR GOV BDFD C-EUR
Société de gestion	BlueBay Asset Management plc
Code ISIN	LU0842209909
Classification AMF	-
Indice de référence	Bloomberg Barclays Euro Aggregate Treasury Index
Type d'investisseur	Tous souscripteurs
Catégorie Quantalys	Obligations Euro Etat
Indice de réf. Quantalys	ML EMU Direct Government

Notation Quantalys

Tendance à 3 mois : Stable

VL 104,24 EUR
(24/09/2018)

Historique base 100 du 24/09/2015 au 24/09/2018



Performances

	Fonds	Catégorie
Performance au 24/09/2018		
Perf. veille	-0,40 %	0,00 %
Perf. 4 semaines	-0,17 %	-0,04 %
Perf. 1er janvier	0,64 %	-1,11 %
Perf. 1 an	2,23 %	-0,70 %
Perf. 3 ans	6,43 %	1,42 %
Perf. 5 ans	-	-
Performance annuelles		
Perf. 2017	3,50 %	-0,12 %
Perf. 2016	-	2,23 %
Perf. 2015	-	-
Données 3 ans au 31/08/2018		
Perf. ann.	2,14 %	0,69 %
Volatilité	2,71 %	2,95 %
Sharpe	0,91	0,34

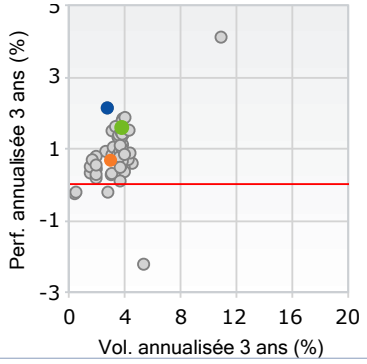
Comportement

Marché	Classement à 3 ans
Très haussier	
Haussier	Mauvais
Neutre	Bon
Baissier	Bon
Très baissier	

Classement du fonds

	Rang	Quartile
1 mois	70 / 86	4
3 mois	51 / 85	3
6 mois	19 / 85	1
YTD	15 / 84	1
1 an	2 / 83	1
3 ans	2 / 76	1
5 ans	-	-

Fonds versus catégorie



Indicateurs généraux

Valeurs à 3 ans		Faible Fort
Perf. ann.	2,14 %	
Surperf. ann.	0,54 %	
Ecart de suivi	2,90 %	
Ratio d'info	0,19	
Beta	0,46	

Indicateurs de risque

Valeurs à 3 ans		Par rapport à la cat
Volatilité	2,71 %	Bon
Perte max	-2,29 %	Très bon
DSR	1,81 %	Bon
Beta bais.	0,34	Très bon
VAR	-0,61 %	Bon

Profil de risque DICI

A risque plus faible							A risque plus élevé
	1	2	**3**	4	5	6	7

Caractéristiques générales

Type	SICAV
Capi/Distri	Capitalisation
Part couverte	Non
Eligible au PEA / PEA PME	Non / Non
Frais maximum	
Souscription	5 %
Rachat	Néant
Gestion	2 %
Surperformance	Néant
Courants	0,41 %
Actif au 04/08/2015	
Actif net de la part	67 793 EUR
Actif net global	1 035 119 754 EUR
Variation de l'actif 3 mois	-17,96 %
Gérant	Gestion collégiale

© 2018 Quantalys. Les informations contenues dans cette fiche appartiennent à Quantalys qui ne garantit ni leur fiabilité, ni leur exhaustivité. Cette fiche fonds vous est fournie à titre indicatif exclusivement par la société Quantalys. Elle ne constitue pas de la part de Quantalys une offre d'achat, de vente, de souscription ou de services financiers, ni une sollicitation d'une offre d'achat de quelque produit d'investissement que ce soit. Lisez le prospectus du fonds avant toute décision d'investissement. Les performances passées ne préjugent pas des performances futures.La notation Quantalys, les indicateurs, le comportement, la position du fonds par rapport à sa catégorie sont en date du 31/08/2018.Toutes les performances et données liées sont calculées en euro et ne sont pas garanties, notamment dans le cas de fonds libellés dans une devise différente de l'euro.

UBS (LUX) INST FD - EMG MKT EQ AA

powered by Quantalys

Fiche d'identité

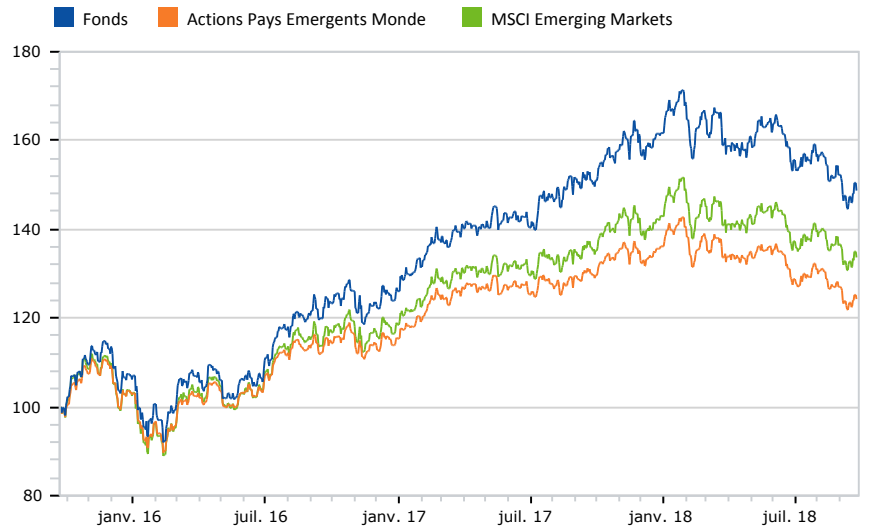
Nom du fonds	UBS (LUX) INST FD - EMG MKT EQ AA
Société de gestion	UBS Asset Management
Code ISIN	LU0200130796
Classification AMF	-
Indice de référence	MSCI Emerging Markets (net div. reinv.)
Type d'investisseur	Institutionnels/Professionnels
Catégorie Quantalys	Actions Pays Emergents Monde
Indice de réf. Quantalys	MSCI Emerging Markets

Notation Quantalys

Tendance à 3 mois : Stable

VL 173,20 USD
(24/09/2018)

Historique base 100 du 24/09/2015 au 24/09/2018



Performances

	Fonds	Catégorie
Performance au 24/09/2018		
Perf. veille	-1,17 %	0,00 %
Perf. 4 semaines	-3,67 %	-2,89 %
Perf. 1er janvier	-8,01 %	-8,71 %
Perf. 1 an	-1,54 %	-4,42 %
Perf. 3 ans	50,63 %	26,20 %
Perf. 5 ans	51,46 %	25,09 %
Performance annuelles		
Perf. 2017	28,22 %	18,01 %
Perf. 2016	17,76 %	11,96 %
Perf. 2015	2,21 %	-4,34 %
Données 3 ans au 31/08/2018		
Perf. ann.	14,55 %	7,56 %
Volatilité	16,65 %	14,26 %
Sharpe	0,89	0,55

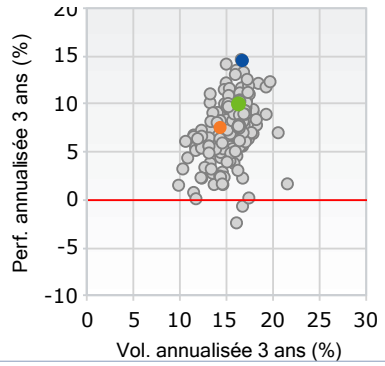
Comportement

Marché	Classement à 5 ans
Très haussier	Très bon
Haussier	Très bon
Neutre	Moyen
Baissier	Moyen
Très baissier	Bon

Classement du fonds

	Rang		Quartile
1 mois	170	/ 321	3
3 mois	214	/ 320	3
6 mois	153	/ 318	2
YTD	134	/ 314	2
1 an	80	/ 306	2
3 ans	2	/ 264	1
5 ans	5	/ 205	1

Fonds versus catégorie



Indicateurs généraux

Valeurs à 3 ans		Faible Fort
Perf. ann.	14,55 %	
Surperf. ann.	4,54 %	
Ecart de suivi	3,00 %	
Ratio d'info	1,51	
Beta	1,01	

Indicateurs de risque

Valeurs à 3 ans		Par rapport à la cat
Volatilité	16,65 %	Mauvais
Perte max	-19,92 %	Bon
DSR	10,57 %	Moyen
Beta bais.	1,00	Mauvais
VAR	-3,88 %	Mauvais

Profil de risque DICI

A risque plus faible							A risque plus élevé
	1	2	3	4	5	**6**	7

Caractéristiques générales

Type	FCP
Capi/Distri	Capitalisation
Part couverte	Non
Eligible au PEA / PEA PME	Non / Non
Frais maximum	
Souscription	3 %
Rachat	Néant
Gestion	1,28 %
Surperformance	Néant
Courants	1,32 %
Actif au 24/09/2018	
Actif net de la part	6 M EUR
Actif net global	20 M EUR
Variation de l'actif 3 mois	72,31 %
Gérant	Gestion collégiale

© 2018 Quantalys. Les informations contenues dans cette fiche appartiennent à Quantalys qui ne garantit ni leur fiabilité, ni leur exhaustivité. Cette fiche fonds vous est fournie à titre indicatif exclusivement par la société Quantalys. Elle ne constitue pas de la part de Quantalys une offre d'achat, de vente, de souscription ou de services financiers, ni une sollicitation d'une offre d'achat de quelque produit d'investissement que ce soit. Lisez le prospectus du fonds avant toute décision d'investissement. Les performances passées ne préjugent pas des performances futures.La notation Quantalys, les indicateurs, le comportement, la position du fonds par rapport à sa catégorie sont en date du 31/08/2018.Toutes les performances et données liées sont calculées en euro et ne sont pas garanties, notamment dans le cas de fonds libellés dans une devise différente de l'euro.

Allocation d'actifs choisie

L'allocation d'actifs choisie ou construite par vous découle de votre choix du type d'optimisation : soit choix d'une allocation dans la plage suggérée en fonction de la durée de l'investissement, soit choix d'une allocation en dehors de la plage suggérée, soit construction d'une allocation d'actifs sur mesure. L'allocation retenue est positionnée par rapport à la frontière efficiente Quantalys, son analyse en VAR (Value at Risk) sur la durée de l'investissement ainsi que la composition de votre allocation d'actifs dans les classes d'actifs de la frontière efficiente sont fournies.

Caractéristiques de l'investissement

Sont mentionnés ici le montant total et la durée de l'investissement, ainsi que le profil de risque de l'investisseur.

Classes d'actifs du portefeuille optimisé

Les fonds du portefeuille optimisé selon vos spécifications sont affectés aux principales classes d'actifs : support en euro ou monétaire, actions, obligations, allocation d'actifs, autres.

Corrélation de deux classes d'actifs

La corrélation entre deux classes d'actifs mesure l'intensité de la relation existant entre la performance de l'une et celle de l'autre. Elle prend des valeurs entre -1 (parfaite corrélation inverse : quand l'une des classes d'actifs monte, l'autre baisse avec la même intensité et vice versa) et +1 (parfaite corrélation : quand l'une des classes d'actifs monte, l'autre monte avec la même intensité et vice versa). Nous utilisons des hypothèses de corrélations attendues entre deux classes d'actifs. Cette hypothèse est fondée sur une analyse des corrélations historiques et sur nos anticipations futures. Elle n'a pas vocation à évoluer fréquemment et n'est pas garantie : la corrélation réelle entre deux classes d'actifs en général (mesurée par un indice de référence par exemple) peut différer sensiblement de la corrélation attendue et peut être supérieure. Le comportement réel des fonds appartenant à ces classes d'actifs présente une très grande dispersion et leur corrélation réelle peut également différer sensiblement de la corrélation attendue pour les deux classes d'actifs et être très supérieure. L'arithmétique du calcul du risque d'un portefeuille est telle qu'il ne s'agit pas simplement de la moyenne pondérée du risque de chacun des composants mais que les corrélations jouent un rôle important : en bref, une corrélation faible entre deux composants d'un portefeuille permet de réduire le risque de celui-ci. Il est donc désirable, pour réduire le risque, d'avoir des corrélations aussi peu élevées que possible : par convention, nous considérons qu'une corrélation supérieure à 0,9 dénote un mauvais potentiel de diversification, qu'une corrélation comprise entre 0,6 et 0,9 dénote un potentiel de diversification moyen et qu'une corrélation inférieure à 0,6 dénote un bon potentiel de diversification. Par diversification, il faut entendre réduction du risque.

Evolution investissement

Ce graphique représente la plage d'évolution statistique dans 95% des cas de l'allocation d'actifs ou du portefeuille de fonds sur la durée d'investissement projetée. La branche haute représente l'hypothèse la plus favorable, la branche basse la moins favorable, et la branche du milieu l'hypothèse moyenne. Ce graphique n'implique aucune garantie et n'est fourni qu'à titre illustratif. Il repose sur les hypothèses de rendement, risque et covariance attendus de chacune des classes d'actifs de l'allocation ou du portefeuille, ainsi que de normalité de la distribution des rendements de cette allocation ou de ce portefeuille, hypothèses qui ne sont pas nécessairement vérifiées.

Liste des fonds du portefeuille final

Tous les fonds du portefeuille optimisé selon vos spécifications sont présentés dans ce tableau regroupés par grandes classes d'actifs. Sont mentionnés : la catégorie Quantalys de chacun des fonds, son code ISIN, sa société de gestion, sa performance cumulée depuis le début de l'année, sur 1 et 3 ans, ainsi que son risque annualisé sur 1 et 3 ans.

Liste des transactions

Cette liste fournit la liste des opérations à effectuer pour construire le portefeuille optimisé selon vos spécifications : achat, vente totale ou partielle, réinvestissement. Sont également indiqués les codes ISIN des fonds et les montants à investir ou vendre par produit, en fonction du montant total de l'investissement que vous avez indiqué.

Performance attendue de l'allocation d'actifs

En fonction de l'allocation d'actifs retenue, nous calculons sur la durée de l'investissement indiquéel'espérance de gain moyenne et la perte maximum (ou le gain minimum) à l'issue de l'investissement et durant la période de l'investissement. Ces calculs de Value At Risk sont faits avec un intervalle de confiance de 95%, ne sont que des estimations et n'impliquent aucune garantie. Dans 2.5% des cas, la performance pourra être inférieure aux minima indiqués dans cette partie.