Annexe 2

A L L O C A T I O N D ' A C T I F S

F O N D S S U R V E I L L E S

30 10 20

ANNÉES	31	32	33	34	35	36	37	38	39	40	41	42	43	44	45	46	47
	F O N D S P E A / P M E							F O N D S "F L E X I B L E S"									
	DNCA Opportunités Zone € C FR0012316180	ECHIQUIER Entrepreneurs FR0011558246	INOCAP Quadrige France SmallCaps FR0011466093	KEREN Finance Keren Essentiels [C] FR0011271550	Tocqueville Finance PME P FR0011608421	Amiral Gestion Sextant PME [A] FR0010547869	SYCOMORE Sélection PME R. FR0011707488	Nordea 1 Stable Return LU0227384020	Amiral Gestion Sextant Grand Large FR0010286013	H2o Asset Management H2O Adagio FR0010923359 / FR0013534898	ROUVIER & Associés Clartan Patrimoine LU1100077442	TRUSTEAM Optimum A FR0007072160	M&G Group M&G Optimal Income LU1670724373	Sunny EuroStrategy R FR0010996629	Athymis Gestion ATHYMIS Patrimoine FR0010772129	Nordea 1 Stable Return LU0227384020	DMS Concept Kaldemorgen LU0599946893
Type fonds	FCP Cap	SICAV Cap	FCP Cap	FCP Cap	FCP Cap	FCP Cap	FCP Cap	SICAV Cap	FCP Cap	FCP Cap	FCP Cap	FCP Cap	SICAV Cap	FCP Cap	FCP Cap	FCP Cap	SICAV Cap
Créé le :	151214	181013	020713	090712	261113	171207	31/07/06	021105	110703	230810	210691	310502	200407	100311	010909	021105	020511
Gère depuis :	011002	181013	020713	090712	011014	171207	01/07/06	021105	110703	230810	010115	310502	081206	100311	011116	021105	020511
par :	Mériaux+	Berros	Bauchet+	Pasqualetti	Voisin	Moreau	Charlot+	Hansen	Badelon	Crastes+	Brisset+	Allain	Woolnough	Cadenat	Chesnay	Hansen	Kaldemorgen
VL d'origine	100	100	100	100	10	100	3100	10	100	100	15	100	10	100	100	10,00	100
Fds de fds?	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	OUI	NON	NON
Enc.[en mion]	115	586	25	36	44	81	68	7713	1289	2849	326	368	14224	214	44	7713	10490
Portef.	Actions	Actions	Actions	Actions	Actions	Actions	Actions	Flexible	Mixte Europe	Oblig.+Dev.	Diversif.	Div.Déf.	Actions	Diversif.	Alloc.flex.	Flexible	Perf. Abs.
Secteurs :	PME/ETI	PME	PME	PME	Zone Euro	PME	Zone Euro	EUR Monde	Act.déf.	Alternatif	U.E. EUR	U.E.	Monde	Intl	prud.Monde	EUR Monde	Act.déf.
Benchmark	MSCI Eur.		MSCI Eur.SC	CAC Mid&Sm	CAC Sm.	CAC Sm.	MSCI Eur.SC	50/50	50/50 Eonia	Glob.Macro	Eonia	Eonia cap.	aucun	Oblig.	EONIA	50/50	Composite
Nb de lignes	55	52	32	54	69	84	85	1494	176	884	65	191	560	-	6		>75-150<
Expo. Actions	92	>90	>90	75 à 100	95		87	0 à 30	25 à 75%	-	0/30	0	2	-	0 à 35%	0 à 30	
% Expo.Act.act.	98	87	93	97	100	81	88	77	42	0	20	9	3	-	30	49,24	
Poche "verte"	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%		0%
Vol. 5 ans	22,09	14,94	19,60	18,39	18,00	13,91	16,51	4,61	5,59	7,24	3,78	3,98	5,82	5,79	5,53	4,61	6,14
Éch.Risq²	6	5	6	5	6	5	5	3	4	4	3	3	4	4	4	3	4
Durée min.conseillée	5 ans	5 ans	5 ans	5 ans	5 ans	5 ans	5 ans	3 ans	3 ans	3 ans	3 ans	3 ans	3 ans	3 ans	3 ans	3 ans	3 ans
Dern.VL	91,5	245,4	167,7	216,2	14,9	206,8	5109	16,3	411,6	140,3	54,0	154,8	10,26	125,6	136,3	16,3	141,84
depuis 01/01/20	-20,46%	6,23%	-21,91%	-7,71%	-8,02%	8,07%	2,97%	-4,91%	-8,99%	-5,16%	-8,37%	-2,83%	-2,21%	-4,66%	-1,05%	-4,91%	-7,09%
2019	0,60%	28,25%	30,67%	8,22%	21,33%	12,75%	14,00%	7,95%	4,62%	6,92%	4,62%	3,96%	6,80%	3,94%	8,46%	8,16%	12,29%
2018	-29,89%	-13,25%	-37,25%	-29,29%	-32,07%	-20,73%	-25,25%	-5,78%	-4,29%	4,85%	-4,09%	-3,66%	-4,95%	-3,47%	-6,33%	-5,78%	-2,71%
2017	16,95%	24,07%	13,64%	21,75%	21,17%	14,53%	19,21%	2,63%	3,91%	4,33%	2,36%	1,90%	4,28%	2,76%	5,11%	2,60%	0,87%
2016	13,87%	13,66%	35,93%	23,64%	18,94%	24,49%	17,36%	2,96%	11,17%	1,55%	2,64%	4,23%	6,96%	5,33%	2,87%	2,96%	0,69%
2015	15,77%	28,39%	31,60%	26,27%	27,83%	24,69%	22,83%	2,58%	13,60%	5,87%	1,63%	-0,13%	-1,62%	0,12%	4,87%	2,58%	1,78%
2014	3,54%	8,05%	0,75%	16,58%	5,02%	13,49%	9,30%	10,49%	11,74%	3,08%	1,66%	3,70%	4,71%	2,44%	4,49%	10,49%	6,97%
2013	-	-	-	30,47%	-	25,31%	30,60%	7,44%	21,03%	5,00%	7,45%	3,77%	7,18%	7,16%	4,45%	7,44%	4,54%
2012	-	-	-	-	-	-	9,60%	6,60%	15,24%	11,63%	10,80%	6,41%	12,96%	16,06%	9,13%	6,60%	10,35%
2011	-	-	-	-	-	-	-	5,88%	-8,36%	-3,03%	-1,51%	-1,04%	6,30%	-	-8,33%	5,88%	-
2010	-	-	-	-	-	-	-	1,58%	24,08%	0,40%	3,65%	2,74%	9,12%	-	7,23%	1,58%	-
2009	-	-	-	-	-	-	-	15,99%	61,70%	-	11,88%	9,84%	34,2%	-	-	15,99%	-
2008	-	-	-	-	-	-	-	-9,74%	-50,00%	-	0,66%	-0,46%	-5,8%	-	-	-9,74%	-
2007	-	-	-	-	-	-	-	0,09%	16,16%	-	3,73%	3,05%	-	-	-	0,09%	-
2006	-	-	-	-	-	-	-	7,52%	12,69%	-	2,54%	2,91%	-	-	-	7,52%	-
2005	-	-	-	-	-	-	-		26,71%	-	1,88%	-	-	-	-		-
2004	-	-	-	-	-	-	-		24,72%	-	3,52%	-	-	-	-		-
2003	-	-	-	-	-	-	-		14,62%	-	3,60%	-	-	-	-		-
2002	-	-	-	-	-	-	-		-	-	8,44%	-	-	-	-		-
2001	-	-	-	-	-	-	-		-	-	4,98%	-	-	-	-		-
2000	-	-	-	-	-	-	-		-	-	3,89%	-	-	-	-		-
1999	-	-	-	-	-	-	-		-	-	-0,73%	-	-	-	-		-
1998	-	-	-	-	-	-	-		-	-	8,49%	-	-	-	-		-
1997	-	-	-	-	-	-	-		-	-	4,74%	-	-	-	-		-
1996	-	-	-	-	-	-	-		-	-	9,92%	-	-	-	-		-
1995	-	-	-	-	-	-	-		-	-	9,79%	-	-	-	-		-
1994	-	-	-	-	-	-	-		-	-	-3,31%	-	-	-	-		-
1993	-	-	-	-	-	-	-		-	-	24,77%	-	-	-	-		-
1992	-	-	-	-	-	-	-		-	-	-	-	-	-	-		-
1991	-	-	-	-	-	-	-		-	-	-	-	-	-	-		-
1990	-	-	-	-	-	-	-		-	-	-	-	-	-	-		-
Moy.Ann.	3,7%	11,7%	7,9%	13,7%	9,0%	14,0%	12,5%	3,4%	10,5%	2,1%	4,2%	2,2%	5,8%	3,1%	3,6%	3,6%	1,9%
*Quantalys	*	*****	*	*	*	*	*	**	**	*****	**	**	****	*	****	***	**
*Morningstar	**	*****	**	**	***	****	****	***	****	NN	***	***	****	***	***	*****	NN
coef : Perf/Vol.	0,17	0,78	0,41	0,74	0,50	1,01	0,76	0,73	1,87	0,28	1,11	0,56	1,00	0,54	0,65	0,84	0,30
Ratio Sharpe	-0,09	0,73	0,10	0,10	0,20	0,51	0,40	0,30	0,47	0,42	0,03	0,35	0,44	0,16	0,38	0,31	0,44
Perte max.[DD]	-49,99	-29,07	-51,96	-56,13	-51,01	-41,54	-46,51	-10,55	-17,28	-18,35	-9,50	-9,77	-15,54	-16,92	-12,80	-5,45%	-15,88
Délai de recouv.	j.	j.	j.	j.	j.	202 j.	195 j.	j.	j.	j.	j.	j.	j.	j.	j.	531 j.	j.
Éligible PEA	OUI	OUI	OUI	OUI	OUI	OUI	OUI	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON
Éligible PEA -PME	NON	OUI	OUI	OUI	OUI	OUI	OUI	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON

ANNÉES	48	49	50	51	52	53	54	55	56	57	58	59	60	61	TOTAL
	F O N D S D Y N A M I Q U E S														
	MONETA Moneta Long Short [A] FR0010400762	MONETA Multi-Caps A FR0010298596	CARMIGNAC Green Gold [ex-Commodities] LU0164455502	CARMIGNAC Emergents [A] FR0010149302	Financière de l'Échiquier Échiquier Agenor MidCap Europe A FR0010321810	H2O Asset Management H2O MultiBonds FR0010923375 / FR0013535952	EDRAM EDR FD China A € LU1163665091	PICTET Water-P EUR C LU0104884860	FEDERAL FINANCE Or & Mat.Prem. FR0000978868	ECHIQUIER Agressor FR0010321802	Amiral Gestion Sextant Autour du Monde A FR0010286021	Amiral Gestion Sextant PEA A FR0010286005	ATHYMIS Gestion Millennial P (€) FR0013173374	AXA IM Aedificandi A D FR0000170193	
Type fonds	FCP Cap	FCP Cap	SICAV Cap	FCP Cap	SICAV Cap	FCP Cap	SICAV Cap	FCP Cap	FCP Cap	FCP Cap	FCP Cap	FCP Cap	FCP Cap	FCP Cap	
Créé le :	221206	240306	100303	300197	270204	230810	080498	190100	021283	291191	080705	180102	210616	290470	
Gère depuis :	221206	240306	011218	010115	010913	230810	250615	010501	021283	011018	080705	180102	210616	220703	
par :	Courty	Burnand+	Wiskirski	Hovasse	Bobtcheff	Crastes+	Bao	Portner	Serra+	Berranger	Badelon	Badelon	Toullieux+	Tempel+	
VL d'origine	100	100	100	152	100	100.02	360	100	15	27.23	100	100	100	30	
Fds de fds?	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	OUI	NON	NON	NON	NON	NON	
Enc.[en mion]	386	1978	308	818	2021	2646	295	6008	15	449	84	182	38	700	
Portef.	Perf. Abs.	Act.Fr. LC	Actions	Actions	Actions	Oblig.LT	Actions	Actions	Actions	Actions	Actions	Actions	Actions	Actions	
Secteurs :	Long Short	Intl	Mat. Pr.	Intl	U.E.	Mixtes Intl	Chine	Intl	Sector.	Eur. S&M	Intl	FR-Small	Monde	Foncières	
Benchmark	Eonia 60%	MSCI Fr.	Multi.	MSCI Em.	MSCI Eur.SC	JPM	MSCI Ch.	Sector.	Multi	MSCI Eur.NR	MSCI W.	MSCI Eur.	75MSCI W	MSCI W RE	
Nb de lignes	82	100	77	44	48	717	68	294	10	39	81	114	56	39	
Expo. Actions	30 à 100%	<100%				0			>90	>80			>90	>90	
% Expo.Act.act.	93	100	93	91	89	0	93	97	95	96,5	90	55	98	98	
Poche "verte"	18%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	
Vol. 5 ans	7,30	15,82	20,90	14,13	13,23	25,93	18,64	13,23	23,83	19,30	12,88	13,05	16,30	14,53	13,52
Éch.Risq²	4	6	6	6	5	7	7	6	6	6	5	5	6	6	
Durée min.conseillée	5 ans	5 ans	5 ans	5 ans	5 ans	5 ans	5 ans	5 ans	5 ans	5 ans	5 ans	5 ans	5 ans	5 ans	
Dern.VL	161,9	245,9	268,1	1175,9	427,7	382,9	437,7	358,6	36,4	1322	198,5	884,8	146,1	333,7	
depuis 01/01/20	-8,93%	-16,07%	-8,07%	21,88%	3,55%	-26,93%	18,19%	-2,64%	-8,49%	-27,62%	-14,98%	-5,00%	9,35%	-19,83%	-5,7%
2019	9,61%	24,51%	14,79%	24,73%	33,85%	32,91%	32,94%	29,40%	21,80%	18,85%	17,50%	11,66%	25,30%	22,40%	15,5%
2018	-7,40%	-15,60%	-17,70%	-18,60%	-8,55%	32,19%	-22,37%	-8,64%	-16,02%	-24,76%	-10,38%	-18,20%	-11,76%	-6,92%	-12,0%
2017	4,90%	16,86%	5,51%	18,84%	21,70%	14,20%	41,39%	9,80%	-1,10%	9,22%	12,10%	13,63%	15,96%	17,40%	11,1%
2016	4,82%	5,07%	21,68%	1,39%	0,41%	11,46%	-8,75%	9,16%	38,30%	0,76%	6,50%	20,21%	4,37%	1,72%	9,8%
2015	7,53%	18,08%	-16,16%	5,15%	25,36%	30,95%	9,03%	10,44%	-22,10%	16,61%	9,33%	22,42%	-	15,40%	10,5%
2014	0,58%	5,20%	7,86%	5,76%	-1,69%	29,99%	23,92%	15,63%	0,66%	3,60%	24,28%	14,53%	-	23,61%	8,0%
2013	11,81%	32,32%	-8,55%	-6,17%	24,3%	10,84%	10,29%	17,15%	-22,6%	21,79%	20,91%	39,27%	-	7,96%	10,1%
2012	12,75%	30,65%	-9,65%	17,28%	23,1%	38,62%	-0,35%	13,6%	-8,9%	26,5%	8,97%	15,73%	-	25,07%	9,1%
2011	-6,50%	-15,60%	-21,12%	-12,09%	-27,9%	-8,54%	-38,9%	-3,0%	-18,5%	-17,8%	-21,86%	-11,61%	-	-15,51%	-6,7%
2010	10,80%	9,10%	42,02%	30,93%	36,34%	-2,00%	14,01%	23,88%	32,76%	28,20%	21,30%	18,25%	-	15,86%	10,2%
2009	39,20%	32,30%	70,27%	68,41%	56,45%	-	67,08%	19,6%	51,61%	45,89%	59,2%	61,80%	-	37,62%	23,3%
2008	-23,70%	-31,50%	-54,5%	-55,9%	-48,5%	-	-52,6%	-34,0%	-46,7%	-46,8%	-62,9%	-58,36%	-	-44,4%	-19,1%
2007	5,90%	8,60%	32,73%	22,83%	-1,73%	-	55,55%	3,14%	20,39%	-0,12%	23,90%	21,71%	-	-19,15%	7,0%
2006	-	16,00%	26,46%	22,19%	23,03%	-	64,62%	22,84%	12,04%	13,40%	24,48%	19,92%	-	51,91%	9,0%
2005	-	-	52,14%	59,47%	35,53%	-	25,65%	26,63%	46,20%	18,39%	-	31,41%	-	27,17%	10,5%
2004	-	-	2,38%	12,13%	12,71%	-	-3,72%	16,37%	9,15%	17,13%	-	29,99%	-	38,07%	4,0%
2003	-	-	41,14%	45,85%	-	-	44,75%	-	26,57%	25,45%	-	63,99%	-	20,71%	8,6%
2002	-	-	-	-11,74%	-	-	-24,7%	-	16,46%	3,11%	-	-	-	8,58%	-0,3%
2001	-	-	-	3,95%	-	-	6,01%	-	23,66%	1,73%	-	-	-	0,82%	1,3%
2000	-	-	-	-22,9%	-	-	-	-	-2,91%	25,63%	-	-	-	2,31%	0,1%
1999	-	-	-	132,2%	-	-	-	-	27,41%	18,98%	-	-	-	11,63%	5,7%
1998	-	-	-	-21,7%	-	-	-	-	-17,9%	15,35%	-	-	-	-	-0,5%
1997	-	-	-	-2,43%	-	-	-	-	-16,8%	28,31%	-	-	-	-	0,4%
1996	-	-	-	-	-	-	-	-	-	20,44%	-	-	-	-	1,0%
1995	-	-	-	-	-	-	-	-	-	2,50%	-	-	-	-	0,4%
1994	-	-	-	-	-	-	-	-	-	21,56%	-	-	-	-	0,6%
1993	-	-	-	-	-	-	-	-	-	82,96%	-	-	-	-	3,5%
1992	-	-	-	-	-	-	-	-	-	2,28%	-	-	-	-	0,1%
1991	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1,80%	-	-	-	-	0,1%
1990	-	-	-	-	-	-	-	-	-		-	-	-	-	0,0%
Moy.Ann.	4,1%	7,2%	10,1%	14,2%	10,8%	8,5%	12,8%	8,7%	5,7%	10,2%	7,2%	16,5%	6,3%	9,2%	7,4%
*Quantalys	**	****	***	*****	*****	***	*	*****	****	*	*	*	****	****	
*Morningstar	NN	****	***	*****	*****	*****	***	****	***	*	**	***	**	****	
coef : Perf/Vol.	0,56	0,45	0,49	1,00	0,82	0,33	0,68	0,66	0,24	0,70	0,56	1,26	0,39	0,64	
Ratio Sharpe	0,06	0,11	0,02	0,52	0,78	-0,18	0,60	0,62	0,27	0,06	0,28	0,33	0,58	0,30	*0,33*
Perte max.[DD]	-20,70	-48,00	-54,19	-28,64	-29,92	-55,87	-31,79	-33,63	-42,97	-31,02%	-32,53	-37,02	-29,70	-40,14	*-31,28*
Délai de recouv.	j.	287 j.	j.	139 j.	187 j.	j.	757 j.	j.	923 j.	643 j.	j.	j.	186 j.	j.	*532 j.*
Éligible PEA	NON	OUI	NON	NON	OUI	NON	NON	NON	NON	OUI	NON	OUI	NON	NON	
Éligible PEA -PME	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	

La Valeur Liquidative des fonds H2O est le résultat de l'addition des VL des fonds FCP et SP, d'où les deux n° ISIN.

[²] : Selon le SRRI [AMF] de 1 à 7.

Les numéros des fonds commencent au numéro 2 car au numéro 1 correspond le fonds général en euros dont les performances diffèrent selon les compagnies d'assurance.

© SIGMA Finance Consult

Document non contractuel

Sur fond vert apparaissent les fonds dits "patrimoniaux".

NN : Non noté.

Une barre en travers de l'intitulé du fonds indique une fermeture temporaire (soft closing), deux barres en croix une fermeture définitive

Sources : Quantalys (pour la plupart des informations), OPCVM360 & Morningstar ou les Maisons de Gestion directement.

nov-20