Annexe 2

ALLOCATION D'ACTIFS

FONDS SUIVIS

30 11 22 — 2/2

ANNÉES	32	33	34	35	36	37	38	39	40	41	42	43	44	45	46	47	48	49	50	51	52	53	54	55	56	57	58	59	60	61	62	TOTAL
	FONDS PEA / PME									FONDS "DÉFENSIFS"									FONDS "DYNAMIQUES"													
	DNCA Opportunités Zone € C	ECHIQUIER Entrepreneurs A	INOCAP Quadrige France SmallCaps C	KEREN Finance Keren Essentiels [C]	Tocqueville Finance PME P	Amiral Gestion Sextant PME [A]	SYCOMORE Sélection PME R	SYCOMORE Europe Éco-Solutions [R] EUR	Amiral Gestion Sextant PEA A	Amiral Gestion Sextant Grand Large A	Nordea 1 Stable Return	CLARTAN Associés Clartan Patrimoine	TRUSTEAM Optimum A	Sunny EuroStrategy R	Athymis Gestion ATHYMIS Patrimoine	DWS Concept Kaldemorgen	H2O Adagio H2o Asset Management	MONETA Moneta Long Short [A]	MONETA Multi-Caps C	CARMIGNAC Climate Transition (ex-Commodities)	CARMIGNAC Emergents [A]	Financière de l'Echiquier Échiquier Agénor	H2O Asset Management H2O MultiBonds	DNCA Invest Norden Europe	PICTET Water-P EUR C	AXA IM World Funds Robotech A €	Ginjer Actifs360 M	AXA IM Amiral Gestion Sextant Autour du Monde A	HMG Découvertes C	ATHYMIS Gestion Millennial P (€)	AXA IM Aedificandi A D	
Type fonds	FCP Cap	SICAV Cap	FCP Cap	FCP Cap	FCP Cap	FCP Cap	FCP Cap	SICAV 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	FCP Cap	FCP Cap	SICAV Cap	SICAV Capi	FCP Cap	SICAV Cap	FCP Cap	FCP Cap	SICAV Cap	FCP Cap	FCP Cap	
Créé le :	151214	181013	020713	090712	261113	171207	310706	310815	180102	110703	021105	210691	310502	100311	010909	020511	230810	221206	240306	100303	300197	270204	230810	021116	190100	191216	160218	080705	261087	210616	290470	
Géré depuis :	011002	181013	020713	090712	011014	171207	010706	310815	180102	110703	021105	010115	310502	100311	011116	020511	230810	221206	240306	201218	010115	010913	230810	021116	010501	191216	301111	080705	160493	210616	220703	
par :	Mériaux++	Berros+	Bauchet+	Pasqualetti	Schang+	Moreau	Charlot+	Préaubert+	Lepage+	D'Arvieu+	Hansen	Brisset+	Allain	Cadenat	Chesnay	Kaldemorgen	Crastes+	Courty	Burnand+	Wiskirski	Hovasse	Bobtchelf+	Crastes+	Auffret+	Lecamp	Riley+	Cohen & Fischer	D'Arvieu	Girault	Toulieux+	Aubry+	
VL d'origine	100	100	100	100	10	100	3100	100	100	100	10	15	100	100	100	100	100	100	100	100	152	100	100	100	100	100	100	100	100	100	30	
Fds de fds?	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	OUI	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	
Enc. [en mion]	818	401	36	33	60	191	58	658	155	868	6203	203	325	137	40	13777	782	439	2806	297	852	1580	2196	552	8332	1238	198	65	82	34	519	
Portef.	Actions	Actions	Actions	Actions	Actions	Actions	Actions	Act. Écologie	Actions	Mixte Europe	Flexible	Diversif.	Div.Déf.	Diversif.	Alloc.flex.	Perf. Abs.	Oblig.+Dev.	Perf. Abs.	Act.Fr. LC	Actions	Actions	Actions	Oblig.LT	Actions Nord.	Actions	Actions	Alloc.Flex.	Actions	Actions	Actions	Actions	
Secteurs :	PME/ETI	PME	PME	PME	Zone Euro	PME	Zone Euro	Monde	FR-Small	Act.déf.	EUR Monde	U.E. EUR	U.E.	Intl	prud.Monde	Act.déf.	Alternatif	Long Short	Intl	Mat. Pr.	Intl	U.E.	Mixtes Intl	Eur.Nord+	Intl.Sector	Technos	Eur.	Intl	France	Monde	Foncières	
Benchmark	MSCI Eur.	MSCI Eu MC	MSCI Eur.SC	CAC Mid&Sm	CAC Sm.	CAC Sm.	MSCI Eur.SC		MSCI Eur.	50/50 Eonia	50/50	Eonia	Eonia cap.	Oblig.	EONIA	Composite	Glob.Macro	Eonia 60%	MSCI Fr.	Multi.	MSCI Em.	MSCI Eur. SC	JPM	Composite	MSCI AC.W	MSCI W.	non-Benchm.	MSCI W.	CAC Small NR	75MSCI W	MSCI W RE	
Nb de lignes	55	52	32	54	69	84	85	76	114	154	708	56	160	112	24	136	884	100	94	59	57	54	717			54		81	45	51	39	
Expo.nette Actions	92	>90	>90	75 à 100	95		87	<100		25 à 75%	0 à 30	0/30	0	-	0 à 35%	0>50	-	30 à 100%	<100%			0				0 à 100			>90	>90	
% Expo.nette Act	98	87	93	97	100	81	88	95	93	50	76	27	6	0	28,11	35	0	38	96	98	85	87	0	96		93	65,7	91	98			
Poche "verte"	0%	ESG/art.8	ESG	ESG/art.8	ESG	ESG	ESG/ISR/art.9	SFDR 9	0%	ESG	0%	0%	ESG/ISR	0%	0%	0%	0%	26%	art.8/ 17%	0%	ISR	0%	0%	ISR	ESG/ISR/30%	ISR	SFDR/art.8	0%	0%	0%	0%	
Volat. 5 ans	23,24	16,92	20,57	19,79	20,48	16,79	18,41	20,04	15,27	6,17	6,72	4,36	3,93	5,96	6,30	6,31	25,76	9,72	20,05	18,53	18,29	17,41	31,39	19,73	16,87	22,21	25,27	13,28	11,98	17,74	19,44	16,09
Ech.Risq²	6	6	6	6	6	6	5	5	6	4	4	3	3	4	4	4	4	4	6	6	6	6	7	6	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	3 ans	3 ans	3 ans	3 ans	3 ans	3 ans	3 ans	3 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	5 ans	
Dern.VL	128,0	223,4	251,0	283,9	18,9	252,5	5360	155,6	1045,6	435,0	17,2	55,4	150,4	123,5	134,6	158,8	145,7	189,7	352,6	305,4	1112,2	393,3	468,5	184,7	454,5	184,4	115,3	228,4	261,73	151,8	286,6	
depuis 01/01/22	-15,24%	-29,51%	-4,69%	-13,39%	-15,50%	-16,19%	-23,32%	-14,37%	-15,06%	-5,61%	-8,73%	-4,47%	-8,63%	-8,29%	-10,35%	-2,98%	*2,06%*	-1,89%	-6,79%	-9,22%	-10,74%	-27,37%	*18,7%*	-30,94%	-14,63%	-23,87%	-5,28%	-11,48%	1,98%	-20,60%	-32,98%	**-11,9%**
2021	29,77%	12,13%	25,23%	23,04%	17,91%	18,29%	18,23%	16,30%	7,12%	3,76%	10,88%	2,19%	2,43%	2,25%	5,68%	9,26%	*7,48%*	6,88%	21,22%	10,39%	-10,73%	15,33%	*3,24%*	38,63%	39,58%	26,09%	25,21%	15,44%	16,63%	18,66%	11,80%	14,3%
2020	1,18%	22,38%	-2,07%	13,38%	16,78%	33,12%	19,16%	28,00%	23,39%	-1,81%	-0,58%	-3,65%	0,89%	-0,02%	3,13%	-1,87%	-9,18%	1,75%	6,53%	4,51%	44,66%	13,64%	-35,80%	30,24%	3,56%	32,04%	-3,56%	-4,28%	4,65%	20,53%	-5,34%	8,2%
2019	30,66%	28,25%	32,02%	3,37%	20,16%	12,75%	12,50%	23,80%	11,66%	4,62%	8,16%	4,29%	3,96%	3,94%	8,46%	12,29%	6,92%	10,17%	25,02%	14,79%	24,73%	33,85%	32,91%	33,80%	34,49%	39,06%	18,14%	17,60%	16,50%	25,12%	23,45%	18,6%
2018	-30,79%	-13,25%	-37,25%	-29,29%	-32,07%	-20,73%	-25,25%	-11,54%	-18,20%	-4,29%	-5,78%	-4,09%	-3,66%	-3,47%	-6,33%	-2,96%	4,85%	-7,90%	-16,86%	-17,70%	-18,60%	-8,55%	32,19%	-9,57%	-8,64%	-11,94%	-	-10,38%	-19,11%	-11,76%	-6,92%	**-11,6%**
2017	12,76%	23,95%	12,72%	21,32%	20,58%	14,16%	18,76%	11,96%	13,63%	3,91%	2,63%	2,36%	1,90%	2,76%	5,11%	0,91%	4,33%	4,91%	16,86%	5,51%	18,84%	21,70%	14,20%	15,67%	9,79%	-	-	12,07%	17,11%	15,96%	17,43%	11,1%
2016	13,87%	13,66%	35,93%	24,08%	18,94%	24,49%	17,36%	5,37%	20,21%	11,17%	2,96%	2,64%	4,23%	5,33%	2,87%	0,69%	1,55%	4,82%	5,07%	21,68%	1,39%	0,41%	11,46%	0,67%	9,16%	-	-	6,50%	23,32%	4,37%	1,72%	9,5%
2015	15,77%	28,39%	31,60%	26,27%	27,83%	24,69%	22,83%	5,16%	22,42%	13,60%	2,58%	1,63%	-0,13%	0,12%	4,87%	1,78%	5,87%	7,53%	18,08%	-16,16%	5,15%	25,36%	30,95%	10,15%	10,44%	-	-	9,33%	28,21%	-	15,40%	12,2%
2014	3,54%	8,05%	0,75%	15,60%	5,02%	13,49%	9,30%	-	14,53%	11,74%	10,49%	1,66%	3,70%	2,44%	4,49%	6,97%	3,08%	0,58%	5,20%	7,86%	5,76%	-1,69%	29,99%	18,82%	15,63%	-	-	24,28%	12,21%	-	23,61%	8,3%
2013	-	-	-	30,47%	-	25,31%	30,60%	-	39,27%	21,03%	7,44%	7,45%	3,77%	7,16%	4,45%	4,54%	5,00%	11,81%	32,32%	-8,55%	-6,17%	24,3%	10,84%	11,1%	17,15%	-	-	20,91%	43,58%	-	7,96%	11,3%
2012	-	-	-	-	-	-	9,60%	-	15,73%	15,24%	6,60%	10,80%	6,41%	16,06%	9,13%	10,35%	11,63%	12,75%	30,65%	-9,65%	17,28%	23,1%	38,62%	17,2%	13,6%	-	-	8,97%	5,78%	-	25,07%	9,5%
2011	-	-	-	-	-	-	-	-	-11,61%	-8,36%	5,88%	-1,51%	-1,04%	-	-8,33%	-	-3,03%	-6,50%	-15,60%	-21,12%	-12,09%	-27,9%	-8,54%	-6,6%	-3,0%	-	-	-21,86%	-13,37%	-	-15,51%	-5,8%
2010	-	-	-	-	-	-	-	-	18,25%	24,08%	1,58%	3,65%	2,74%	-	7,23%	-	0,40%	10,80%	9,10%	42,02%	30,93%	36,34%	-2,00%	-	23,88%	-	-	21,30%	20,93%	-	15,86%	8,6%
2009	-	-	-	-	-	-	-	-	61,80%	61,70%	15,99%	11,88%	9,84%	-	-	-	-	39,20%	32,30%	70,27%	68,41%	56,45%	-	-	19,6%	-	-	59,2%	23,47%	-	37,62%	18,3%
2008	-	-	-	-	-	-	-	-	-58,36%	-50,00%	-9,74%	0,66%	-0,46%	-	-	-	-	-23,70%	-31,50%	-54,5%	-55,9%	-48,5%	-	-	-34,0%	-	-	-62,9%	-	-	-44,4%	-15,3%
2007	-	-	-	-	-	-	-	-	21,71%	16,16%	0,09%	3,73%	3,05%	-	-	-	-	5,90%	8,60%	32,73%	22,83%	-1,73%	-	-	3,14%	-	-	23,90%	-	-	-19,15%	3,9%
2006	-	-	-	-	-	-	-	-	19,92%	12,69%	7,52%	2,54%	2,91%	-	-	-	-	-	16,00%	26,46%	22,19%	23,03%	-	-	22,84%	-	-	24,48%	-	-	51,91%	7,5%
2005	-	-	-	-	-	-	-	-	31,41%	26,71%	-	1,88%	-	-	-	-	-	-	-	52,14%	59,47%	35,53%	-	-	26,63%	-	-	-	-	-	27,17%	8,4%
2004	-	-	-	-	-	-	-	-	29,99%	24,72%	-	3,52%	-	-	-	-	-	-	-	2,38%	12,13%	12,71%	-	-	16,37%	-	-	-	-	-	38,07%	4,5%
2003	-	-	-	-	-	-	-	-	63,99%	14,62%	-	3,60%	-	-	-	-	-	-	-	41,14%	45,85%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	20,71%	6,1%
2002	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	8,44%	-	-	-	-	-	-	-	-	-11,74%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	8,58%	0,2%
2001	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	4,98%	-	-	-	-	-	-	-	-	3,95%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,82%	0,3%
2000	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	3,89%	-	-	-	-	-	-	-	-	-22,9%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	2,31%	-0,5%
1999	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-0,73%	-	-	-	-	-	-	-	-	132,2%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	11,63%	4,6%
1998	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	8,49%	-	-	-	-	-	-	-	-	-21,7%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-0,4%
1997	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	4,74%	-	-	-	-	-	-	-	-	-2,43%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,1%
1996	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	9,92%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,3%
1995	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	9,79%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,3%
1994	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-3,31%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-0,1%
1993	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	24,77%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,8%
1992	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,0%
1991	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,0%
1990	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,0%
Moy.Ann	**6,7%**	**10,2%**	**10,4%**	**11,4%**	**8,7%**	**12,8%**	**9,8%**	**7,9%**	**15,5%**	**9,8%**	**3,4%**	**4,0%**	**1,8%**	**2,5%**	**2,3%**	**3,5%**	**2,6%**	**4,8%**	**9,2%**	**9,7%**	**13,1%**	**10,7%**	**13,7%**	**10,5%**	**10,7%**	**11,8%**	**10,2%**	**7,6%**	**12,6%**	**-0,3%**	**8,7%**	**8,3%**
*Quantalys	*****	**	****	*****	*****	*****	****	*****	*****	***	****	*	***	*****	***	*****	*	**	*****	NN	*****	*	*	***	****	**	***	*	***	**	**	
*Morningstar	**	***	***	***	***	****	**	**	****	****	***	***	***	***	****	****	NN	***	****	***	****	****	NN	*****	***	***	***	***	*****	**	****	
coef : Perf/Volat.	0,29	0,60	0,51	0,57	0,42	0,76	0,53	0,40	1,02	1,58	0,50	0,93	0,47	0,42	0,36	0,56	0,10	0,49	0,46	0,52	0,72	0,62	0,44	0,53	0,64	0,53	0,41	0,57	1,05	-0,02	0,45	
Ratio de Sharpe	-0,05	0,06	-0,06	-0,19	-0,07	0,13	-0,17	0,16	-0,06	-0,20	0,08	-0,27	-0,32	-0,21	-0,01	0,41	-0,46	0,16	0,19	-1,09	0,08	0,15	*0,17*	0,40	0,53	0,36	0,14	-0,05	0,24	0,26	-0,15	*0,01*
Perte max.[DD]	-49,99	-39,30	-51,96	-56,13	-51,01	-41,54	-46,51	-34,78	-37,02	-17,28	-13,06	-10,68	-12,57	-16,92	-13,69	-15,88	-9,25	-20,69	-40,08	-24,15	-40,09	-36,83	-29,78	-38,36	-33,63	-35,13	-39,85	-32,53	-32,70	-31,99	-43,93	***-32,17*** %
Délai de recouv.	1200 j.	137 j.	j.	j.	1171 j.	888 j.	1108 j.	866 j.	1016 j.	1120 j.	398 j.	j.	*1120* j.	350 j.	300 j.	400 j.	91 j.	331 j.	308 j.	1250 j.	139 j.	187 j.	j.	132 j.	327 j.	109 j.	426 j.	380 j.	1018 j.	186 j.	529 j.	*542 j.*
Éligible PEA	OUI	OUI	OUI	OUI	OUI	OUI	OUI	OUI	OUI	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	OUI	NON	NON	OUI	NON	OUI	NON	NON	NON	NON	OUI	NON	NON	
Éligible PEA -PME	NON	OUI	OUI	OUI	OUI	OUI	OUI	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	

Sur fond vert apparaissent les fonds dits "patrimoniaux".

[²] : Selon le SRRI [AMF] de 1 à 7, du moins risqué au plus exposé.

Document non contractuel

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.

© SIGMA Finance Consult

déc-22