Annexe 2

ALLOCATION D'ACTIFS

FONDS SUIVIS

29 04 22 — 2/2

ANNÉES	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	63	TOTAL
	FONDS PEA / PME								FONDS FLEXIBLES										FONDS DYNAMIQUES													
	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	Amiral Gestion Sextant PEA A FR0010286005	Amiral Gestion Sextant Grand Large FR0010286013	Nordea 1 Stable Return LU0227384020	CLARTAN Associés Clartan Patrimoine LU1100077442	TRUSTEAM Optimum A FR0007072160	TOBAM Anti-Benchmark Multi-Assets LU1899106733	Sunny EuroStrategy R FR0010996629	Athymis Gestion ATHYMIS Patrimoine FR0010772129	DWS Concept Kaldemorgen LU0599946893	H2O Adagio H2o Asset Management FR0010923359 / FR0013534898	MONETA Moneta Long Short [A] FR0010400762	MONETA Multi-Caps C FR0010298596	CARMIGNAC Green Gold [ex-Commodities] LU0164455502	CARMIGNAC Emergents [A] FR0010149302	Financière de l'Echiquier Echiquier Agénor FR0010321810	H2O Asset Management H2O MultiBonds FR0010923375 / FR0013535952	DNCA Invest Norden Europe LU1490785091	PICTET Water-P EUR C LU0104884860	AXA IM World Funds Robotech A € LU1134921650	ECHIQUIER Agressor FR0010321802	Amiral Gestion Sextant Autour du Monde A FR0010286021	HMG Découvertes C FR0010603971	ATHYMIS Gestion Millennial P (€) FR0013173374	AXA IM Aedificandi A D FR0000170193	
Type fonds	FCP Cap	SICAV Cap	FCP Cap	FCP Cap	FCP Cap	FCP Cap	FCP Cap	FCP Cap	FCP Cap	SICAV Cap	FCP Cap	SICAV Cap	FCP Cap	FCP Cap	FCP Cap	SICAV Cap	FCP Cap	FCP Cap	FCP Cap	SICAV Cap	FCP Cap	FCP Cap	FCP Cap	SICAV Cap	FCP Cap	FCP Cap	FCP Cap	FCP Cap	FCP Cap	FCP Cap	FCP Cap	
Créé le :	151214	181013	020713	090712	261113	171207	310706	180102	110703	021105	210691	310502	151216	100311	010909	020511	230810	221206	240306	100303	300197	270204	230810	021116	190100	191216	291191	080705	261087	210616	290470	
Géré depuis :	011002	181013	020713	090712	011014	171207	010706	180102	110703	021105	010115	310502	160519	100311	011116	020511	230810	221206	240306	201218	010115	010913	230810	021116	010501	191216	011018	080705	160493	210616	220703	
par :	Mériaux++	Berros+	Bauchet+	Pasqualetti	Schang+	Moreau	Charlot+	Lepage+	D'Arvieu+	Hansen	Brisset+	Allain	Michel	Cadenat	Chesnay	Kaldemorgen	Crastes+	Courty	Burnand+	Wiskirski	Hovasse	Bobtcheff+	Crastes+	Auffret+	Lecamp	Riley+	Berranger+	D'Arvieu	Girault	Toulieux+	Aubry+	
VL d'origine	100	100	100	100	10	100	3100	100	100	10	15	100	100	100	100	100	100	100	100	100	152	100	100	100	100	100	27,23	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]	851	470	34	37	66	202	64	176	1026	7333	233	383	131	161	46	13446	885	446	2840	327	802	1924	2202	685	8751	1443	438	72	85	39	667	
Portef.	Actions	Actions	Actions	Actions	Actions	Actions	Actions	Actions	Mixte Europe	Flexible	Diversif.	Div.Déf.	Alloc.EUR	Diversif.	Alloc.flex.	Perf. Abs.	Oblig.+Dev.	Perf. Abs.	Act.Fr. LC	Actions	Actions	Actions	Oblig.LT	Actions Nord.	Actions	Actions	Actions	Actions	Actions	Actions	Actions	
Secteurs :	PME/ETI	PME	PME	PME	Zone Euro	PME	Zone Euro	FR-Small	Act.déf.	EUR Monde	U.E. EUR	U.E.	mod. Intl	Intl	prud.Monde	Act.déf.	Alternatif	Long Short	Intl	Mat. Pr.	Intl	U.E.	Mixtes Intl	Eur.Nord+	Intl.Sector	Technos	Eur. S&M	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.	50 MSCI W	Oblig.	EONIA	Composite	Glob.Macro	Eonia 60%	MSCI Fr.	Multi.	MSCI Em.	MSCI Eur. SC	JPM	Composite	MSCI AC.W	MSCI W.	MSCI Eur.NR	MSCI W.	CAC Small NR	75MSCI W	MSCI W RE	
Nb de lignes	55	52	32	54	69	84	85	114	154	708	56	160	362	112	24	136	884	102	99	59	57	54	717				39	81	45	51	39	
Expo.nette Actions	92	>90	>90	75 à 100	95		87		25 à 75%	0 à 30	0/30	0	50,3	-	0 à 35%	0>50	-	30 à 100%	<100%				0				>80			>90	>90	
% Expo.nette Act	98	87	93	97	100	81	88	93	50	76	27	6	33,7	0	28,11	51	0	48	100	98	85	87	0	96			99	93	65,7	91	98	
Poche "verte"	0%	ESG/art.8	ESG	ESG/art.8	ESG	ESG	ESG/ISR/art.9	0%	ESG	0%	0%	ESG/ISR	ESG/art.8	0%	0%	0%	0%	26%	art.8/ 26%	0%	ISR	0%	0%	ISR	ESG/ISR/30%	ISR	0%	0%	0%	0%	0%	
Volat. 5 ans	22,44	15,78	19,94	19,03	19,75	15,85	17,47	14,76	5,93	6,00	4,03	3,34	9,50	5,58	5,78	6,14	25,63	9,53	19,53	14,96	17,84	16,00	31,18	18,32	15,64	20,46	20,33	12,99	11,48	16,56	17,52	14,82
Ech.Risq²	6	5	6	6	6	6	5	5	4	3	3	3	4	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	3 ans	3 ans	3 ans	3 ans	4 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	130,8	250,1	254,3	299,8	20,8	268,1	5961	1128,7	458,2	17,9	56,8	156,3	120,2	129,6	140,0	162,9	136,7	191,9	354,0	295,6	1062,2	424,0	414,1	212,3	477,0	192,0	1603	242,7	245,55	159,0	391,4	
depuis 01/01/22	-13,43%	-21,09%	-3,44%	-8,55%	-6,68%	-11,01%	-14,72%	-8,31%	-0,57%	-4,88%	-1,98%	-5,08%	-9,14%	-3,74%	-6,78%	-0,49%	0,31%	-0,76%	-6,42%	-12,13%	-14,75%	-21,69%	3,2%	-20,62%	-10,41%	-20,74%	-10,84%	-5,95%	-4,33%	-16,84%	-8,48%	-8,7%
2021	29,77%	12,13%	25,23%	23,04%	17,91%	18,29%	18,23%	7,12%	3,76%	10,88%	2,19%	2,43%	-0,64%	2,25%	5,68%	9,26%	1,48%	6,88%	21,22%	10,39%	-10,73%	15,33%	3,24%	38,63%	39,58%	26,09%	16,68%	15,44%	16,63%	18,66%	11,80%	13,5%
2020	1,18%	22,38%	-2,07%	13,38%	16,78%	33,12%	19,16%	23,39%	-1,81%	-0,58%	-3,65%	0,89%	7,66%	-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%	-15,68%	-4,28%	4,65%	20,53%	-5,34%	7,2%
2019	30,66%	28,25%	32,02%	3,37%	20,16%	12,75%	12,50%	11,66%	4,62%	8,16%	4,29%	3,96%	12,53%	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%	18,85%	17,60%	16,50%	25,12%	23,45%	18,3%
2018	-30,79%	-13,25%	-37,25%	-29,29%	-32,07%	-20,73%	-25,25%	-18,20%	-4,29%	-5,78%	-4,09%	-3,66%	-6,88%	-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%	-24,76%	-10,38%	-19,11%	-11,76%	-6,92%	-12,3%
2017	12,76%	23,95%	12,72%	21,32%	20,58%	14,16%	18,76%	13,63%	3,91%	2,63%	2,36%	1,90%	4,45%	2,76%	5,11%	0,91%	4,33%	4,91%	16,86%	5,51%	18,84%	21,70%	14,20%	15,67%	9,79%	-	9,22%	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%	20,21%	11,17%	2,96%	2,64%	4,23%	3,03%	5,33%	2,87%	0,69%	1,55%	4,82%	5,07%	21,68%	1,39%	0,41%	11,46%	0,67%	9,16%	-	0,76%	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%	22,42%	13,60%	2,58%	1,63%	-0,13%	2,51%	0,12%	4,87%	1,78%	5,87%	7,53%	18,08%	-16,16%	5,15%	25,36%	30,95%	10,15%	10,44%	-	16,61%	9,33%	28,21%	-	15,40%	12,7%
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%	-	3,60%	24,28%	12,21%	-	23,61%	8,4%
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%	-	21,79%	20,91%	43,58%	-	7,96%	12,0%
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%	-	26,5%	8,97%	5,78%	-	25,07%	10,4%
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%	-	-17,8%	-21,86%	-13,37%	-	-15,51%	-6,4%
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%	-	28,20%	21,30%	20,93%	-	15,86%	9,5%
2009	-	-	-	-	-	-	-	61,80%	61,70%	15,99%	11,88%	9,84%	-	-	-	-	-	39,20%	32,30%	70,27%	68,41%	56,45%	-	-	19,6%	-	45,89%	59,2%	23,47%	-	37,62%	19,8%
2008	-	-	-	-	-	-	-	-58,36%	-50,00%	-9,74%	0,66%	-0,46%	-	-	-	-	-	-23,70%	-31,50%	-54,5%	-55,9%	-48,5%	-	-	-34,0%	-	-46,8%	-62,9%		-	-44,4%	-16,8%
2007	-	-	-	-	-	-	-	21,71%	16,16%	0,09%	3,73%	3,05%	-	-	-	-	-	5,90%	8,60%	32,73%	22,83%	-1,73%	-	-	3,14%	-	-0,12%	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%	-	13,40%	24,48%		-	51,91%	7,9%
2005	-	-	-	-	-	-	-	31,41%	26,71%	-	1,88%	-	-	-	-	-	-	-	-	52,14%	59,47%	35,53%	-	-	26,63%	-	18,39%	-		-	27,17%	9,0%
2004	-	-	-	-	-	-	-	29,99%	24,72%	-	3,52%	-	-	-	-	-	-	-	-	2,38%	12,13%	12,71%	-	-	16,37%	-	17,13%	-		-	38,07%	5,1%
2003	-	-	-	-	-	-	-	63,99%	14,62%	-	3,60%	-	-	-	-	-	-	-	-	41,14%	45,85%	-	-	-	-	25,45%	-		-	20,71%	6,9%
2002	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	8,44%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-11,74%	-	-	-	-	3,11%	-		-	8,58%	0,3%
2001	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	4,98%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	3,95%	-	-	-	-	1,73%	-		-	0,82%	0,4%
2000	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	3,89%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-22,9%	-	-	-	-	25,63%	-		-	2,31%	0,3%
1999	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-0,73%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	132,2%	-	-	-	-	18,98%	-		-	11,63%	5,2%
1998	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	8,49%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-21,7%	-	-	-	-	15,35%	-		-		0,1%
1997	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	4,74%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-2,43%	-	-	-	-	28,31%	-		-	-	1,0%
1996	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	9,92%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	20,44%	-		-	-	1,0%
1995	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	9,79%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	2,50%	-		-	-	0,4%
1994	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-3,31%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	21,56%	-		-	-	0,6%
1993	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	24,77%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	82,96%	-		-	-	3,5%
1992	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	2,28%	-		-	-	0,1%
1991	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1,80%	-		-	-	0,1%
1990	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,0%
Moy.Ann.	**4,1%**	**6,7%**	**9,8%**	**10,3%**	**8,3%**	**11,3%**	**8,1%**	**15,1%**	**10,0%**	**3,1%**	**4,0%**	**1,5%**	**-0,6%**	**2,3%**	**1,6%**	**3,7%**	**2,5%**	**4,8%**	**8,5%**	**8,4%**	**11,9%**	**8,9%**	**12,9%**	**8,2%**	**9,9%**	**4,6%**	**10,2%**	**7,2%**	**11,4%**	**-6,0%**	**9,2%**	**6,8%**
*Quantalys	*****	**	***	***	***	*****	****	****	***	****	*	***	****	****	***	****	*	**	*****	NN	****	**	**	*****	*****	**	*	*	***	*	**	
*Morningstar	**	****	**	**	***	***	***	***	****	***	***	***	****	***	****	****	NN	***	****	***	***	****	NN	*****	***	**	*	***	*****	**	*****	
coef : Perf/Volat.	0,18	0,42	0,49	0,54	0,42	0,71	0,46	1,02	1,68	0,51	0,99	0,45	-0,06	0,41	0,27	0,60	0,10	0,50	0,43	0,56	0,67	0,55	0,41	0,45	0,64	0,23	0,70	0,56	0,99	-0,36	0,52	
Ratio de Sharpe	0,09	0,38	0,10	0,08	0,20	0,39	0,15	0,25	0,20	0,29	0,01	0,08	0,42	0,09	0,25	0,55	-0,38	0,29	0,34	-0,33	0,24	0,43	-0,39	0,70	0,68	0,63	-0,23	0,24	0,42	0,45	0,30	*0,22*
Perte max.[DD]	-49,99	-29,07	-51,96	-56,13	-51,01	-41,54	-46,51	-37,02	-17,28	-10,55	-9,50	-9,77	-19,64	-16,92	-12,80	-15,88	-30,71	-20,69	-40,08	-21,19	-30,67	-29,92	-45,63	-31,05	-33,63	-32,41	-53,67	-32,53	-32,70	-29,70	-40,14	*-31,62* %
Délai de recouv.	1200 j.	137 j.	j.	j.	1171 j.	888 j.	1108 j.	1016 j.	1120 j.	398 j.	j.	1120 j.	179 j.	350 j.	300 j.	400 j.	j.	331 j.	308 j.	1250 j.	139 j.	187 j.	j.	132 j.	327 j.	109 j.	307 j.	380 j.	1018 j.	186 j.	529 j.	*576 j.*
Éligible PEA	OUI	OUI	OUI	OUI	OUI	OUI	OUI	OUI	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	OUI	NON	NON	OUI	NON	OUI	NON	NON	OUI	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 SRI [AMF] de 1 à 7.

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

mai-22