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 I V I S

31 03 22 — 2/2

ANNÉES	33 DNCA Opportunités Zone € C FR0012316180	34 ECHIQUIER Entrepreneurs FR0011558246	35 INOCAP Quadrige France SmallCaps FR0011466093	36 KEREN Finance Keren Essentiels [C] FR0011271550	37 Tocqueville Finance PME P FR0011608421	38 Amiral Gestion Sextant PME [A] FR0010547869	39 SYCOMORE Sélection PME R FR0011707488	40 Amiral Gestion Sextant PEA A FR0010286005
	F O N D S P E A / P M E							
Type fonds	FCP Cap	SICAV Cap	FCP Cap	FCP Cap	FCP Cap	FCP Cap	FCP Cap	FCP Cap
Créé le :	151214	181013	020713	090712	261113	171207	310706	180102
Géré depuis :	011002	181013	020713	090712	011014	171207	010706	180102
par :	Mériaux++	Berros+	Bauchet+	Pasquaretti	Schang+	Moreau	Charlot+	Lepage+
VL d'origine	100	100	100	100	10	100	3100	100
Fds de fds?	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON
Enc.[en mion]	852	505	33	37	66	206	69	181
Portef.	Actions	Actions	Actions	Actions	Actions	Actions	Actions	Actions
Secteurs :	PME/ETI	PME	PME	PME	Zone Euro	PME	Zone Euro	FR-Small
Benchmark	MSCI Eur.	MSCI Eu MC	MSCI Eur.SC	CAC Mid&Sm	CAC Sm.	CAC Sm.	MSCI Eur.SC	MSCI Eur.
Nb de lignes	55	52	32	54	69	84	85	114
Expo.nette Actions	92	>90	>90	75 à 100	95		87	
% Expo.nette Act	98	87	93	97	100	81	88	93
Poche "verte"	0%	ESG/art.8	ESG	ESG/art.8	ESG	ESG	ESG/ISR/art.9	0%
Volat. 5 ans	21,76	15,34	19,80	18,59	19,58	15,30	17,03	14,34
Ech.Risq²	6	5	6	6	6	6	5	5
Durée min.conseillée	5 ans	5 ans	5 ans	5 ans	5 ans	5 ans	5 ans	5 ans
Dern.VL	132,9	261,7	257,8	301,9	21,1	275,4	6245	1146,0
depuis 01/01/22	-12,17%	-17,51%	-2,11%	-7,90%	-4,99%	-8,37%	-10,65%	-6,91%
2021	29,77%	12,13%	25,23%	23,04%	17,91%	18,29%	18,23%	7,12%
2020	1,18%	22,38%	-2,07%	13,38%	16,78%	33,12%	19,16%	23,39%
2019	30,66%	28,25%	32,02%	3,37%	20,16%	12,75%	12,50%	11,66%
2018	-30,79%	-13,25%	-37,25%	-29,29%	-32,07%	-20,73%	-25,25%	-18,20%
2017	12,76%	23,95%	12,72%	21,32%	20,58%	14,16%	18,76%	13,63%
2016	13,87%	13,66%	35,93%	24,08%	18,94%	24,49%	17,36%	20,21%
2015	15,77%	28,39%	31,60%	26,27%	27,83%	24,69%	22,83%	22,42%
2014	3,54%	8,05%	0,75%	15,60%	5,02%	13,49%	9,30%	14,53%
2013	-	-	-	30,47%	-	25,31%	30,60%	39,27%
2012	-	-	-	-	-	-	9,60%	15,73%
2011	-	-	-	-	-	-	-	-11,61%
2010	-	-	-	-	-	-	-	18,25%
2009	-	-	-	-	-	-	-	61,80%
2008	-	-	-	-	-	-	-	-58,36%
2007	-	-	-	-	-	-	-	21,71%
2006	-	-	-	-	-	-	-	19,92%
2005	-	-	-	-	-	-	-	31,41%
2004	-	-	-	-	-	-	-	29,99%
2003	-	-	-	-	-	-	-	63,99%
2002	-	-	-	-	-	-	-	-
2001	-	-	-	-	-	-	-	-
2000	-	-	-	-	-	-	-	-
1999	-	-	-	-	-	-	-	-
1998	-	-	-	-	-	-	-	-
1997	-	-	-	-	-	-	-	-
1996	-	-	-	-	-	-	-	-
1995	-	-	-	-	-	-	-	-
1994	-	-	-	-	-	-	-	-
1993	-	-	-	-	-	-	-	-
1992	-	-	-	-	-	-	-	-
1991	-	-	-	-	-	-	-	-
1990	-	-	-	-	-	-	-	-
Moy.Ann.	3,1%	5,9%	10,1%	9,7%	8,4%	11,2%	8,2%	15,0%
*Quantalys	*****	****	***	***	***	*****	****	*****
*Morningstar	**	****	**	**	**	***	***	***
coef : Perf/Volat.	0,14	0,39	0,51	0,52	0,43	0,73	0,48	1,04
Ratio de Sharpe	0,19	0,58	0,06	0,09	0,19	0,50	0,25	0,36
Perte max.[DD]	-49,99	-29,07	-51,96	-56,13	-51,01	-41,54	-46,51	-37,02
Délai de recouv.	1200 j.	137 j.	j.	j.	1171 j.	888 j.	1108 j.	1016 j.
Éligible PEA	OUI	OUI	OUI	OUI	OUI	OUI	OUI	OUI
Éligible PEA -PME	NON	OUI	OUI	OUI	OUI	OUI	OUI	NON

ANNÉES	41 Amiral Gestion Sextant Grand Large FR0010286013	42 Nordea 1 Stable Return LU0227384020	43 CLARTAN Associés Clartan Patrimoine LU1100077442	44 TRUSTEAM Optimum A FR0007072160	45 TOBAM Anti-Benchmark Multi-Assets LU1899106733	46 Sunny EuroStrategy R FR0010996629	47 Athymis Gestion ATHYMIS Patrimoine FR0010772129	48 DWS Concept Kaldemorgen LU0599946893	49 H2O Adagio H2o Asset Management FR0010923359 / FR0013534898	50 MONETA Moneta Long Short [A] FR0010400762
	F O N D S F L E X I B L E S									
Type fonds	FCP Cap	SICAV Cap	FCP Cap	FCP Cap	SICAV Cap	FCP Cap	FCP Cap	SICAV Cap	FCP Cap	FCP Cap
Créé le :	110703	021105	210691	310502	151216	100311	010909	020511	230810	221206
Géré depuis :	110703	021105	010115	310502	160519	100311	011116	020511	230810	221206
par :	D'Arvieu+	Hansen	Brisset+	Allain	Michel	Cadenat	Chesnay	Kaldemorgen	Crastes+	Courty
VL d'origine	100	10	15	100	100	100	100	100	100	100
Fds de fds?	NON	NON	NON	NON	NON	NON	OUI	NON	NON	NON
Enc.[en mion]	1012	7466	236	385	134	167	48	13092	918	444
Portef.	Mixte Europe	Flexible	Diversif.	Div.Déf.	Alloc.EUR	Diversif.	Alloc.flex.	Perf. Abs.	Oblig.+Dev.	Perf. Abs.
Secteurs :	Act.déf.	EUR Monde	U.E. EUR	U.E.	mod. Intl	Intl	prud.Monde	Act.déf.	Alternatif	Long Short
Benchmark	50/50 Eonia	50/50	Eonia	Eonia cap.	50 MSCI W	Oblig.	EONIA	Composite	Glob.Macro	Eonia 60%
Nb de lignes	154	708	56	160	362	112	6	136	884	102
Expo.nette Actions	25 à 75%	0 à 30	0/30	0	50,3	-	0 à 35%	0>50	-	30 à 100%
% Expo.nette Act	50	76	27	6	33,7	0	23	51	0	48
Poche "verte"	ESG	0%	0%	ESG/ISR	ESG	0%	0%	0%	0%	26%
Volat. 5 ans	5,83	5,92	3,87	3,29	9,41	5,56	5,72	6,08	7,68	9,34
Ech.Risq²	4	3	3	3	4	4	4	4	4	4
Durée min.conseillée	3 ans	3 ans	3 ans	3 ans	4 ans	3 ans	3 ans	3 ans	3 ans	5 ans
Dern.VL	459,5	18,1	56,8	158,8	124,9	131,7	142,8	162,7	138,9	194,7
depuis 01/01/22	-0,28%	-3,87%	-1,97%	-3,52%	-5,56%	-2,23%	-4,87%	-0,51%	*1,91%*	0,70%
2021	3,76%	10,88%	2,19%	2,43%	-0,64%	2,25%	5,68%	9,26%	*1,48%*	6,88%
2020	-1,81%	-0,58%	-3,65%	0,89%	7,66%	-0,02%	3,13%	-1,87%	-9,18%	1,75%
2019	4,62%	8,16%	4,29%	3,96%	12,53%	3,94%	8,46%	12,29%	6,92%	10,17%
2018	-4,29%	-5,78%	-4,09%	-3,66%	-6,88%	-3,47%	-6,33%	-2,96%	4,85%	-7,90%
2017	3,91%	2,63%	2,36%	1,90%	4,45%	2,76%	5,11%	0,91%	4,33%	4,91%
2016	11,17%	2,96%	2,64%	4,23%	3,03%	5,33%	2,87%	0,69%	1,55%	4,82%
2015	13,60%	2,58%	1,63%	-0,13%	2,51%	0,12%	4,87%	1,78%	5,87%	7,53%
2014	11,74%	10,49%	1,66%	3,70%	-	2,44%	4,49%	6,97%	3,08%	0,58%
2013	21,03%	7,44%	7,45%	3,77%	-	7,16%	4,45%	4,54%	5,00%	11,81%
2012	15,24%	6,60%	10,80%	6,41%	-	16,06%	9,13%	10,35%	11,63%	12,75%
2011	-8,36%	5,88%	-1,51%	-1,04%	-	-	-8,33%	-	-3,03%	-6,50%
2010	24,08%	1,58%	3,65%	2,74%	-	-	7,23%	-	0,40%	10,80%
2009	61,70%	15,99%	11,88%	9,84%	-	-	-	-	-	39,20%
2008	-50,00%	-9,74%	0,66%	-0,46%	-	-	-	-	-	-23,70%
2007	16,16%	0,09%	3,73%	3,05%	-	-	-	-	-	5,90%
2006	12,69%	7,52%	2,54%	2,91%	-	-	-	-	-	-
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.	10,0%	3,0%	3,9%	1,6%	0,1%	2,5%	1,6%	3,6%	3,0%	5,1%
*Quantalys	**	***	*	***	***	***	***	***	**	**
*Morningstar	****	***	**	***	****	**	****	***	NN	***
coef : Perf/Volat.	1,72	0,51	1,02	0,47	0,01	0,45	0,29	0,60	0,40	0,55
Ratio de Sharpe	0,19	0,39	0,06	0,25	0,50	0,15	0,39	0,52	0,23	0,36
Perte max.[DD]	-17,28	-10,55	-9,50	-9,77	-19,64	-16,92	-12,80	-15,88	-18,35	-20,69
Délai de recouv.	1120 j.	398 j.	j.	1120 j.	179 j.	350 j.	300 j.	400 j.	j.	331 j.
Éligible PEA	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON
Éligible PEA -PME	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON	NON

ANNÉES	51 MONETA Multi-Caps C FR0010298596	52 CARMIGNAC Green Gold [ex-Commodities] LU0164455502	53 CARMIGNAC Emergents [A] FR0010149302	54 Financière de l'Échiquier Échiquier Agénor FR0010321810	55 H2O Asset Management H2O MultiBonds FR0010923375 / FR0013535952	56 DNCA Invest Norden Europe LU1490785091	57 PICTET Water-P EUR C LU0104884860	58 AXA IM World Funds Robotech A € LU1534921650	59 ECHIQUIER Agressor FR0010321802	60 Amiral Gestion Sextant Autour du Monde A FR0010286021	61 HMG Découvertes C FR0010601971	62 ATHYMIS Gestion Millennial P (€) FR0011773374	63 AXA IM Aedificandi A D FR0000170193	TOTAL
	F O N D S D Y N A M I Q U E S													
Type fonds	FCP Cap	SICAV Cap	FCP Cap	SICAV Cap	FCP Cap	SICAV Cap	FCP Cap	FCP Cap	FCP Cap	FCP Cap	SICAV Cap	FCP Cap	FCP Cap	
Créé le :	240306	100303	300197	270204	230810	021116	190100	191216	291191	080705	261087	210616	290470	
Géré depuis :	240306	201218	010115	010913	230810	021116	010501	191216	011018	080705	160493	210616	220703	
par :	Burnand+	Wskirski	Hovasse	Bobtcheff+	Crastes+	Auffret+	Lecamp	Riley+	Berranger+	D'Arvieu	Girault	Toullieux+	Aubry+	
VL d'origine	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	
Enc.[en mion]	2899	343	846	2033	2185	722	8705	1616	454	74	87	41	695	
Portef.	Act.Fr. LC	Actions	Actions	Actions	Oblig.LT	Actions Nord.	Actions	Actions	Actions	Actions	Actions	Actions	Actions	
Secteurs :	Intl	Mat. Pr.	Intl	U.E.	Mixtes Intl	Eur.Nord+	Intl.Sector	Technos	Eur. S&M	Intl	France	Monde	Foncières	
Benchmark	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	ç;	59	57	54	717				39	81	45	56	39	
Expo.nette Actions	<100%				0				>80			>90	>90	
% Expo.nette Act	100	98	85	87	0	96			99	93	65,7	91	98	
Poche "verte"	art.8/ 26%	0%	ISR	0%	0%	ISR	ESG/ISR/30%	ISR	0%	0%	0%	0%	0%	
Volat. 5 ans	18,21	21,46	17,09	15,31	26,65	17,69	15,52	19,90	20,00	12,82	11,59	16,16	15,28	13,94
Ech.Risq²	6	6	6	5	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	5 ans	5 ans	5 ans	5 ans	
Dern.VL	360,4	308,2	1102,4	446,6	400,3	223,1	477,7	206,5	1653	248,2	249,87	166,6	408,1	
depuis 01/01/22	-4,70%	-8,40%	-11,53%	-17,52%	*-0,7%*	-16,59%	-10,28%	-14,75%	-8,02%	-3,80%	-2,65%	-12,84%	-4,56%	-6,7%
2021	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	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	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	-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	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	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	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	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	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	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	-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	9,10%	42,02%	30,93%	36,34%	-2,00%	-	23,88%	-	28,20%	21,30%	20,93%	-	15,86%	9,5%
2009	32,30%	70,27%	68,41%	56,45%	-	-	19,6%	-	45,89%	59,2%	23,47%	-	37,62%	19,8%
2008	-31,50%	-54,5%	-55,9%	-48,5%	-	-	-34,0%	-	-46,8%	-62,9%		-	-44,4%	-16,8%
2007	8,60%	32,73%	22,83%	-1,73%	-	-	3,14%	-	-0,12%	23,90%		-	-19,15%	3,9%
2006	16,00%	26,46%	22,19%	23,03%	-	-	22,84%	-	13,40%	24,48%		-	51,91%	7,9%
2005	-	52,14%	59,47%	35,53%	-	-	26,63%	-	18,39%	-		-	27,17%	9,0%
2004	-	2,38%	12,13%	12,71%	-	-	16,37%	-	17,13%	-		-	38,07%	5,1%
2003	-	41,14%	45,85%	-	-	-	-	-	25,45%	-		-	20,71%	6,9%
2002	-	-	-11,74%	-	-	-	-	-	3,11%	-		-	8,58%	0,3%
2001	-	-	3,95%	-	-	-	-	-	1,73%	-		-	0,82%	0,4%
2000	-	-	-22,9%	-	-	-	-	-	25,63%	-		-	2,31%	0,3%
1999	-	-	132,2%	-	-	-	-	-	18,98%	-		-	11,63%	5,2%
1998	-	-	-21,7%	-	-	-	-	-	15,35%	-		-	-	0,1%
1997	-	-	-2,43%	-	-	-	-	-	28,31%	-		-	-	1,0%
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.	8,5%	8,5%	11,8%	8,6%	11,9%	7,8%	9,4%	5,3%	10,2%	7,4%	11,6%	-6,2%	9,5%	6,8%
*Quantalys	*****	*	*****	**	****	*****	*****	*****	*	*	***	**	***	
*Morningstar	****	***	***	****	NN	*****	***	**	*	**	*****	**	*****	
coef : Perf/Volat.	0,47	0,40	0,69	0,56	0,45	0,44	0,61	0,26	0,70	0,58	1,00	-0,38	0,62	
Ratio de Sharpe	0,46	0,37	0,37	0,63	*0,15*	0,82	0,66	0,75	-0,14	0,32	0,43	0,60	0,40	*0,36*
Perte max.[DD]	-40,08	-54,19	-30,67	-29,92	-55,87	-31,05	-33,63	-32,41	-53,67	-32,53	-32,70	-29,70	-40,14	*-32,62* %
Délai de recouv.	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	NON	NON	OUI	NON	OUI	NON	NON	OUI	NON	OUI	NON	NON	
Éligible PEA -PME	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

avr-22