

FLEXQUANT – Juin 2022
Perf. 2022* : -7.14%
Classt. 2022* : 101/ 545

L'allocation arbitre en 2 sous-allocations dont la composition est stable : la 1re est 100% actions et investi sur 5 thématiques surperformantes à long terme, la 2nd est investie en emprunts d'Etats. L'objectif du modèle est de battre les marchés d'actions tout en protégeant les actifs des fortes baisses. Il s'appuie sur 5 indicateurs de nature macro-économique et financière.

Lancement : déc. 2012
Expo actions 0-100
Gestion quantitative

Performances*	MTD	YTD	2021	2020	2019	depuis jan.-00 **	depuis lancement	Annualisée **
	-2.19%	-7.14%	13.07%	-2.79%	10.08%	435.40%	81.20%	7.65%

Classement* (décile) et Performances	YTD	1 an	3 ans	5 ans
	2 ^e -7.14%	1 ^{er} -0.39%	4 ^e 5.85%	1 ^{er} 22.44%

* Données au 03/07/22 - Sources : ETFinances, Lili2.am, Quantalys catégorie Allocation Flexible Monde, SRRI 3 à 5, approx 545 fonds

** y.c backtest

Données Techniques	Volatilité	Volatilité attendue	Sharpe	Frais de gestion
	5.95%	3.38%	-0.93	0.14%

