



Rapport réalisé par :
Stéphane Guérin
Adali Conseil
14 rue de la chancellerie
78000 Versailles
le 01/09/2026

Portefeuille

UAF LIFE - allocation au
28/08/2026



Fiche d'identité

Allocation de supports



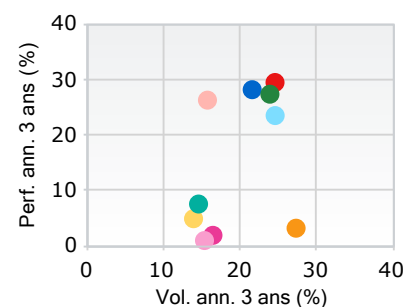
15,0%	BNPP Turkey Equity Classic EUR Acc
10,0%	BGF World Healthscience Fund A2 EUR
10,0%	BGF World Technology Fund A2 EUR
10,0%	Comgest Growth India USD Acc
10,0%	EdR India A EUR
10,0%	FF Japan Value Fund A EUR Hedged
10,0%	Pictet Biotech P USD Acc
10,0%	Pictet Gbl Env Opp P EUR Acc
10,0%	Pictet Robotics P EUR Acc
5,0%	HMG Africa Picking Fund A

Performances cumulées

1 mois :	3,90 %	YTD :	12,99 %
1 an :	20,68 %	2025 :	1,56 %
3 ans :	48,42 %	2024 :	22,13 %
5 ans :	65,70 %	2023 :	21,28 %
Création :	581,97 %		

Performances calendaires

Rend./Risque au 28/08/2026



Composition du portefeuille

Nom	ISIN	Note	Poids	Montant €	VL €	Catégorie	Risque
BNPP Turkey Equity Classic EUR Acc	LU0265293521	☆☆☆☆☆	15,0	0,30	280,56	Actions Pays Emergents	6/7
BGF World Healthscience Fund A2 EUR	LU0171307068	☆☆☆☆☆	10,0	0,20	68,16	Actions Sectorielles	4/7
BGF World Technology Fund A2 EUR	LU0171310443	☆☆☆☆☆	10,0	0,20	125,60	Actions Sectorielles	5/7
Comgest Growth India USD Acc	IE00B03DF997	☆☆☆☆☆	10,0	0,20	58,81	Actions Pays Emergents	4/7
EdR India A EUR	FR0010479931	☆☆☆☆☆	10,0	0,20	483,23	Actions Pays Emergents	4/7
FF Japan Value Fund A EUR Hedged	LU0611489658	☆☆☆☆☆	10,0	0,20	63,00	Actions Asie	4/7
Pictet Biotech P USD Acc	LU0090689299	☆☆☆☆☆	10,0	0,20	1 347,06	Actions Sectorielles	5/7
Pictet Gbl Env Opp P EUR Acc	LU0503631714	☆☆☆☆☆	10,0	0,22	379,80	Actions Sectorielles	4/7
Pictet Robotics P EUR Acc	LU1279334210	☆☆☆☆☆	10,0	0,20	524,74	Actions Sectorielles	5/7
HMG Africa Picking Fund A	FR0011884550	☆☆☆☆☆	5,0	0,10	154,06	Actions Pays Emergents	4/7

*Détails complet des fonds dans la partie "Liste des fonds du portefeuille"

Baromètre

Marchés



Classements	
Très haussier	■■■■■
Haussier	■■■■■
Neutre	■■■■■
Baissier	■■■■■
Très baissier	■■■■■

Classements

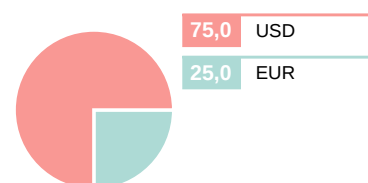
Allocation du portefeuille

50,0 %	Actions sectorielles
40,0 %	Actions Emergentes
10,0 %	Actions Pacifique

Indicateurs de risque

SRI	1	2	3	4	5	6	7
Volatilité 3 ans							
Perte Max 3 ans							
DSR 3 ans							

Exposition aux devises



Diversification	38,34 %	■■■■■
Qualité des fonds	2,7	■■■■■
Fonds ESG	100,0 %	■■■■■
Frais courants moyens	1,98 %	■■■■■



Performances glissantes

Données	1 sem.	1 mois	3 mois	6 mois	1 an	3 ans	5 ans	8 ans	10 ans
Performance Cumulée (%)	1,04	4,46	5,17	7,37	19,92	49,64	65,14	143,67	178,77
Performance Annualisée (%)	-	-	-	-	19,92	14,38	10,55	11,78	10,80
Volatilité (%)	-	-	12,19	14,19	11,84	12,55	12,88	14,58	13,87
Sharpe	-	-	1,66	0,93	1,51	0,92	0,66	0,73	0,72
Perte Max. (%)	-0,40	-1,88	-5,07	-8,54	-9,60	-20,67	-20,67	-29,40	-29,40

Performances calendaires

Données	YTD	2025	2024	2023	2022	2021	2020	2019
Performance (%)	12,99	1,56	22,13	21,28	-2,73	14,11	13,31	23,91
Volatilité (%)	13,14	13,35	12,00	9,85	14,47	15,68	22,67	9,86
Sharpe	-	-0,05	1,54	1,83	-0,19	0,94	0,61	2,47
Perte Max	9,60	20,20	10,06	6,89	15,20	10,26	29,40	7,31

Zoom produits perf. cumulées

Poids %	Libelle	Code ISIN	YTD	1 an	3 ans	5 ans	Date valeur	Notation
15,00	BNPP Turkey Equity Classic EUR Acc	LU0265293521	8,27 %	2,30 %	9,82 %	125,64 %	28/08/2026	☆☆☆☆☆
10,00	EdR India A EUR	FR0010479931	-9,28 %	-10,17 %	2,86 %	2,14 %	28/08/2026	☆☆☆☆☆
10,00	Pictet Biotech P USD Acc	LU0090689299	19,07 %	61,19 %	83,88 %	56,08 %	31/08/2026	☆☆☆☆☆
10,00	Comgest Growth India USD Acc	IE00B03DF997	-6,62 %	-7,51 %	5,79 %	12,43 %	28/08/2026	☆☆☆☆☆
10,00	FF Japan Value Fund A EUR Hedged	LU0611489658	22,93 %	40,53 %	110,63 %	183,58 %	28/08/2026	☆☆☆☆☆
10,00	BGF World Healthscience Fund A2 EUR	LU0171307068	6,57 %	18,27 %	14,23 %	21,52 %	31/08/2026	☆☆☆☆☆
10,00	BGF World Technology Fund A2 EUR	LU0171310443	31,24 %	39,12 %	107,95 %	70,86 %	31/08/2026	☆☆☆☆☆
10,00	Pictet Gbl Env Opp P EUR Acc	LU0503631714	14,72 %	12,41 %	21,98 %	13,59 %	31/08/2026	☆☆☆☆☆
10,00	Pictet Robotics P EUR Acc	LU1279334210	30,39 %	46,86 %	99,60 %	93,15 %	31/08/2026	☆☆☆☆☆
5,00	HMG Africa Picking Fund A	FR0011884550	10,53 %	27,87 %	101,41 %	81,78 %	28/08/2026	☆☆☆☆☆

Historique du 28/08/2023 au 28/08/2026



Performances et ratios sur 3 ans au 28/08/2026

Libellé	Perf. cum.	Perf. ann.	Volatilité	Perte max	Sortino	Sharpe
UAF LIFE - allocation Adali	47,92	13,94	12,55	20,67	1,28	0,88



■ INFORMATIONS COMPLÉMENTAIRES

Conseil en investissements financiers (CIF) membre de l'association professionnelle agréée par l'Autorité des Marchés Financiers (AMF) « ANACOFI-CIF ».

(Les affiliations et agréments mentionnés ci-dessus sont ceux du conseiller utilisant Quantalys ou de la structure qui l'emploie).



Liste des fonds du portefeuille

Nom	ISIN	VL	Perf. YTD	Perf. 1A	Perf. 3A	Perf. 5A	Date perf.	Sharpe 1A	Risque 1A	Sharpe 3A	Risque 3A	Sharpe 5A	Risque 5A	Notation
Actions														
 HMG Africa Picking Fund A	FR0011884550	154,06 EUR	10,53	27,87	101,41	81,78	28/08/26	2,86	9,98	1,49	15,62	0,75	14,56	★★★★★
 EdR India A EUR	FR0010479931	483,23 EUR	-9,28	-10,17	2,86	2,14	28/08/26	-0,85	15,51	-0,07	15,37	0,00	15,09	★★★★★
 Pictet Biotech P USD Acc	LU0090689299	1 568,38 USD	19,07	61,19	83,88	56,08	31/08/26	3,10	19,42	0,78	24,40	0,33	23,66	★★★★★
 Comgest Growth India USD Acc	IE00B03DF997	68,47 USD	-6,62	-7,51	5,79	12,43	28/08/26	-0,66	17,62	0,01	16,46	0,10	15,56	★★★★★
 FF Japan Value Fund A EUR Hedged	LU0611489658	63,00 EUR	22,93	40,53	110,63	183,58	28/08/26	1,64	22,79	1,06	21,36	1,04	18,88	★★★★★
 BGF World Healthscience Fund A2 EUR	LU0171307068	68,16 EUR	6,57	18,27	14,23	21,52	31/08/26	0,86	15,41	0,11	13,76	0,14	13,41	★★★★★
 BGF World Technology Fund A2 EUR	LU0171310443	125,60 EUR	31,24	39,12	107,95	70,86	31/08/26	1,01	27,07	0,94	24,58	0,37	24,29	★★★★★
 Pictet Gbl Env Opp P EUR Acc	LU0503631714	379,80 EUR	14,72	12,41	21,98	13,59	31/08/26	0,43	13,93	0,23	14,45	0,10	16,09	★★★★★
 Pictet Robotics P EUR Acc	LU1279334210	524,74 EUR	30,39	46,86	99,60	93,15	31/08/26	1,18	22,53	0,74	23,55	0,43	24,00	★★★★★
 BNPP Turkey Equity Classic EUR Acc	LU0265293521	280,56 EUR	8,27	2,30	9,82	125,64	28/08/26	-0,19	26,16	0,17	27,82	0,51	32,51	★★★★★

* La date mentionnée dans le tableau est celle de la dernière VL disponible et du calcul des performances cumulées depuis le début de l'année et sur 1, 3 et 5 ans. Les performances sont indiquées en pourcentage. Le ratio de Sharpe, le risque (qui correspond à la volatilité annualisée des rendements hebdomadaires) et la notation Quantalys sont calculés au 28/08/2026. Pour l'année en cours, tant que le rendement annuel définitif du ou des supports en euro n'a pas été publié, la performance indicative est égale au taux minimum garanti pour l'année, ou, quand un tel taux minimum garanti n'existe pas, est fixée par convention par Quantalys à 1,00%.



Fiche d'identité - HMG Africa Picking Fund A - FR0011884550

Société	HMG Finance
Type d'investisseur	Tous souscripteurs
Classification AMF	Actions internationales
Indice de référence	MSCI Emerging Frontier Markets Africa ex South Africa (...)
Catégorie Quantalys	Actions Pays Emergents autres zones
Indice de réf. Quantalys	MSCI Emerging Markets NR
Gérant	Marc GIRAULT ; Paul GIRAULT
Evaluation ISR globale	SFDR
	Article 8



Valeur liquidative

154,06 EUR

28/08/2026



Notation Quantalys

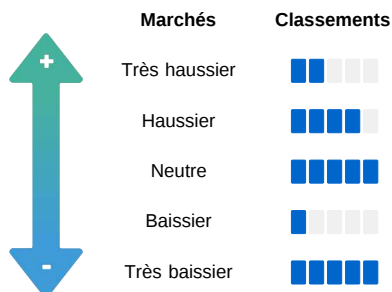
Historique base 100 du 29/08/2023 au 28/08/2026



Performance

Perf. 28/08/2026	Fonds	Catégorie
Perf. veille	0,26 %	0,07 %
Perf. 4 semaines	2,78 %	4,80 %
Perf. 1er janvier	10,53 %	10,43 %
Perf. 1 an	27,87 %	15,75 %
Perf. 3 ans	101,41 %	42,54 %
Perf. 5 ans	81,78 %	48,36 %
Perf. 8 ans	72,75 %	79,08 %
Perf. 10 ans	75,13 %	98,66 %
Performances annuelles		
Perf. 2025	34,12 %	9,29 %
Perf. 2024	13,33 %	14,25 %
Perf. 2023	36,68 %	10,55 %
Données 3 ans au 31/07/2026		
Perf. ann.	26,20 %	10,16 %
Volatilité	15,62 %	9,90 %
Sharpe	1,49	0,73

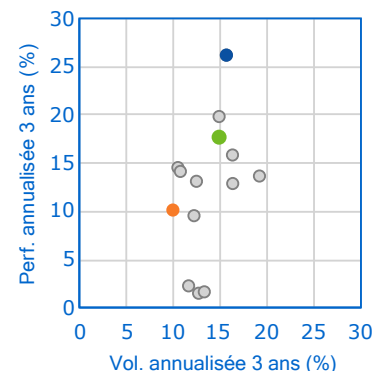
Baromètre Quantalys



Classement de la performance au 31/07/2026

	Rang	Quartile
1 mois	8 / 24	2
3 mois	4 / 24	1
6 mois	2 / 24	1
YTD	7 / 24	2
1 an	3 / 24	1
3 ans	1 / 23	1
5 ans	2 / 21	1
8 ans	8 / 18	2
10 ans	12 / 17	3

Fonds versus catégorie



Indicateurs de risque

Valeurs à 3 ans	Par rapport à la cat
Volatilité	15,62 % Mauvais
Perte max	-23,95 % Très mauvais
DSR	11,37 % Très mauvais
Beta bais.	0,34 Très bon
VAR	-2,41 % Bon

SRI	1	2	3	4	5	6	7
-----	---	---	---	---	---	---	---

L'œil de l'expert

Valeurs à 3 ans	Par rapport à la cat
Sharpe	1,49 Très bon
Ratio d'info.	0,41 Moyen
Sortino	2,05 Très bon
Omega	1,79 Très bon
Calmar	0,95 Très bon

Caractéristiques générales

Type	SICAV
Capi/Distri	Capitalisation
Part couverte	Non
Fonds de fonds	Non
Eligible PEA	Non
Eligible PEA PME	Non
Actif au 28/08/2026	9,69 M
Variation de l'actif 3 mois	21,76 %
Frais maximum	
Souscription	Néant
Rachat	Néant
Gestion	2,1 %
Surperformance	10 %
Frais courants	1,94 %
Frais de gestion PRIIPS	1,94 %
Frais de transaction	0,42 %

© 2026 Quantalys. Les informations contenues dans cette fiche appartiennent à Quantalys qui ne garantit ni leur fiabilité, ni leur exhaustivité. Cette fiche fonds vous est fournie à titre indicatif exclusivement par la société Quantalys. Elle ne constitue pas de la part de Quantalys une offre d'achat, de vente, de souscription ou de services financiers, ni une sollicitation d'une offre d'achat de quelque produit d'investissement que ce soit. Lisez le prospectus du fonds avant toute décision d'investissement. Les performances passées ne préjugent pas des performances futures. La notation Quantalys, les indicateurs, le comportement, la position du fonds par rapport à sa catégorie sont en date du 31/07/2026. Toutes les performances et données liées sont calculées en euro et ne sont pas garanties, notamment dans le cas de fonds libellés dans une devise différente de l'euro.



Fiche d'identité - EdR India A EUR - FR0010479931

Société	Edmond de Rothschild AM
Type d'investisseur	Tous souscripteurs
Classification AMF	Actions internationales
Indice de référence	MSCI India 10/40 (NR) (a posteriori)
Catégorie Quantalys	Actions Inde
Indice de réf. Quantalys	MSCI India NR
Gérant	Patricia URBANO(2023-12-15) Bing YUAN(2025-07-18)

Evaluation ISR globale



SFDR

Article 8

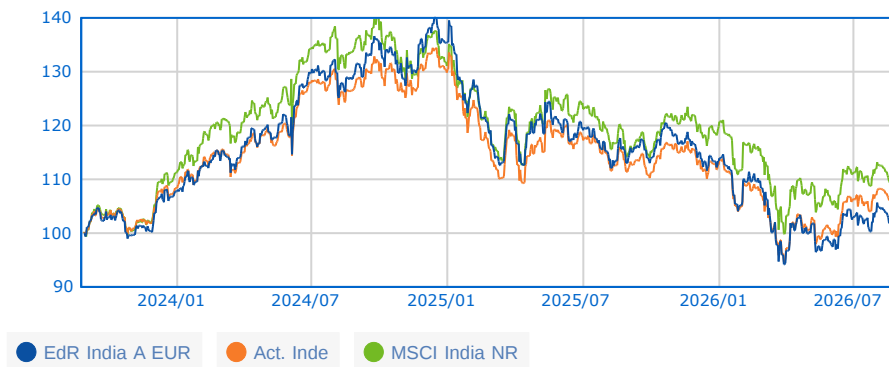
Valeur liquidative

483,23 EUR

28/08/2026



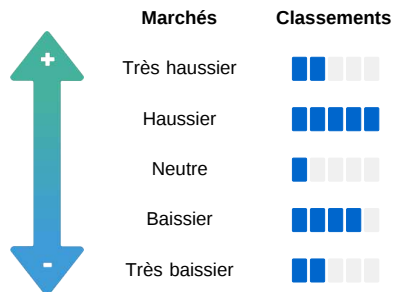
Historique base 100 du 29/08/2023 au 28/08/2026



Performance

Perf. 28/08/2026	Fonds	Catégorie
Perf. veille	0,44 %	0,33 %
Perf. 4 semaines	-0,97 %	-0,23 %
Perf. 1er janvier	-9,28 %	-5,21 %
Perf. 1 an	-10,17 %	-4,95 %
Perf. 3 ans	2,86 %	6,83 %
Perf. 5 ans	2,14 %	12,69 %
Perf. 8 ans	41,08 %	52,50 %
Perf. 10 ans	77,23 %	79,70 %
Performances annuelles		
Perf. 2025	-16,25 %	-13,54 %
Perf. 2024	25,65 %	20,29 %
Perf. 2023	13,97 %	16,19 %
Données 3 ans au 31/07/2026		
Perf. ann.	1,77 %	2,59 %
Volatilité	15,37 %	14,29 %
Sharpe	-0,07	-0,02

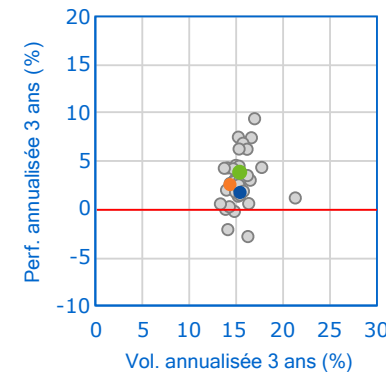
Baromètre Quantalys



Classement de la performance au 31/07/2026

	Rang	Quartile
1 mois	44 / 81	3
3 mois	73 / 81	4
6 mois	73 / 80	4
YTD	72 / 80	4
1 an	69 / 78	4
3 ans	43 / 61	3
5 ans	45 / 57	4
8 ans	29 / 38	3
10 ans	18 / 32	3

Fonds versus catégorie



Indicateurs de risque

Valeurs à 3 ans	Par rapport à la cat
Volatilité	15,37 % Mauvais
Perte max	-32,65 % Mauvais
DSR	10,85 % Mauvais
Beta bais.	0,91 Moyen
VAR	-3,54 % Moyen

SRI	1	2	3	4	5	6	7
-----	---	---	---	---	---	---	---

L'œil de l'expert

Valeurs à 3 ans	Par rapport à la cat
Sharpe	-0,07 Mauvais
Ratio d'info.	-0,44 Moyen
Sortino	-0,10 Mauvais
Omega	1,01 Mauvais
Calmar	-0,03 Mauvais

Caractéristiques générales

Type	FCP
Capi/Distri	Capitalisation
Part couverte	Non
Fonds de fonds	Non
Eligible PEA	Non
Eligible PEA PME	Non
Actif au 28/08/2026	77,10 M
Variation de l'actif 3 mois	3,08 %
Frais maximum	
Souscription	3 %
Rachat	Néant
Gestion	1,85 %
Surperformance	15 %
Frais courants	2,09 %
Frais de gestion PRIIPS	2 %
Frais de transaction	2,36 %

© 2026 Quantalys. Les informations contenues dans cette fiche appartiennent à Quantalys qui ne garantit ni leur fiabilité, ni leur exhaustivité. Cette fiche fonds vous est fournie à titre indicatif exclusivement par la société Quantalys. Elle ne constitue pas de la part de Quantalys une offre d'achat, de vente, de souscription ou de services financiers, ni une sollicitation d'une offre d'achat de quelque produit d'investissement que ce soit. Lisez le prospectus du fonds avant toute décision d'investissement. Les performances passées ne préjugent pas des performances futures. La notation Quantalys, les indicateurs, le comportement, la position du fonds par rapport à sa catégorie sont en date du 31/07/2026. Toutes les performances et données liées sont calculées en euro et ne sont pas garanties, notamment dans le cas de fonds libellés dans une devise différente de l'euro.

Valeur liquidative

31/08/2026

Labels



E

9

G

Towards Sustainability



SFDR

Article 9



Notation Quantalys

Performance



● Act. Sect. Biotech

● MSCI World Biotechnology NR

Perf. 31/08/2026	Fonds	Catégorie
Perf. veille	-2,47 %	-2,75 %
Perf. 4 semaines	4,97 %	5,17 %
Perf. 1er janvier	19,07 %	18,82 %
Perf. 1 an	61,19 %	48,70 %
Perf. 3 ans	83,88 %	54,43 %
Perf. 5 ans	56,08 %	20,20 %
Perf. 8 ans	102,98 %	63,83 %
Perf. 10 ans	146,23 %	106,56 %
Performances annuelles		
Perf. 2025	33,02 %	21,91 %
Perf. 2024	5,01 %	2,73 %
Perf. 2023	9,82 %	-0,55 %
Données 3 ans au 31/07/2026		
Perf. ann.	21,82 %	13,58 %
Volatilité	24,40 %	19,14 %
Sharpe	0.78	0.56

Classement de la performance au 31/07/2026



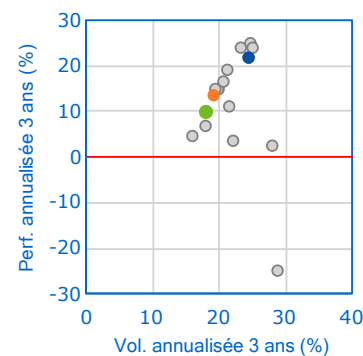
Marchés

Classements

Très haussier	
Haussier	
Neutre	
Baissier	
Très baissier	

	Rang	Quartile
1 mois	12 / 40	2
3 mois	11 / 40	2
6 mois	7 / 40	1
YTD	12 / 40	2
1 an	12 / 40	2
3 ans	5 / 29	1
5 ans	6 / 28	1
8 ans	4 / 22	1
10 ans	5 / 19	1

Fonds versus catégorie



L'œil de l'expert

Valeurs à 3 ans		Par rapport à la cat	
Volatilité	24,40 %		Mauvais
Perte max	-36,28 %		Très mauvais
DSR	16,26 %		Mauvais
Beta bais.	1,06		Mauvais
VAR	-5,28 %		Très mauvais

Valeurs à 3 ans		Par rapport à la cat	
Sharpe	0,78		Très bon
Ratio d'info.	0,64		Bon
Sortino	1,16		Très bon
Omega	1,35		Très bon
Calmar	0,51		Bon

Caractéristiques générales

Type	SICAV
Capi/Distri	Capitalisation
Part couverte	Non
Fonds de fonds	Non
Eligible PEA	Non
Eligible PEA PME	Non
Actif au 31/08/2026	510,35 M
Variation de l'actif 3 mois	12,39 %
Frais maximum	
Souscription	5 %
Rachat	1 %
Gestion	2,4 %
Surperformance	Néant
Frais courants	1,99 %
Frais de gestion PRIIPS	1,99 %
Frais de transaction	0,16 %

© 2026 Quantalys. Les informations contenues dans cette fiche appartiennent à Quantalys qui ne garantit ni leur fiabilité, ni leur exhaustivité. Cette fiche fonds vous est fournie à titre indicatif exclusivement par la société Quantalys. Elle ne constitue pas de la part de Quantalys une offre d'achat, de vente, de souscription ou de services financiers, ni une sollicitation d'une offre d'achat de quelque produit d'investissement que ce soit. Lisez le prospectus du fonds avant toute décision d'investissement. Les performances passées ne préjugent pas des performances futures. La notation Quantalys, les indicateurs, le comportement, la position du fonds par rapport à sa catégorie sont en date du 31/07/2026. Toutes les performances et données liées sont calculées en euro et ne sont pas garanties, notamment dans le cas de fonds libellés dans une devise différente de l'euro.



Fiche d'identité - Comgest Growth India USD Acc - IE00B03DF997

Société	Comgest AM International Limited
Type d'investisseur	Tous souscripteurs
Classification AMF	-
Indice de référence	MSCI India
Catégorie Quantalys	Actions Inde
Indice de réf. Quantalys	MSCI India NR
Gérant	Madhabushi (2021-01-08), Singh (2018-09-05)
Evaluation ISR globale	SFDR
	Article 8



Valeur liquidative

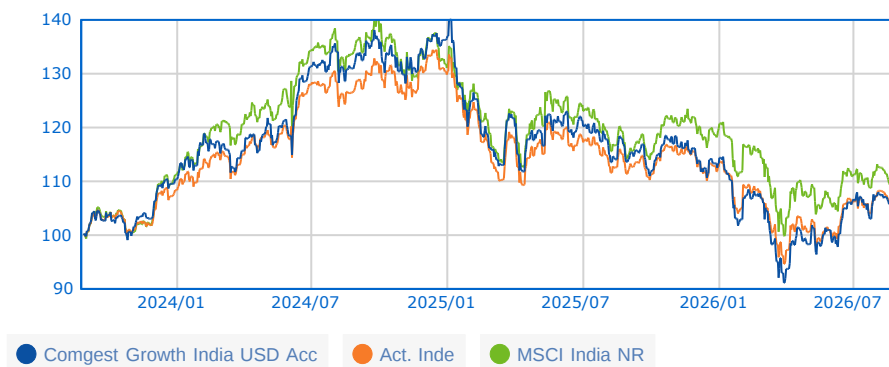
68,47 USD

= 58,81 EUR

28/08/2026



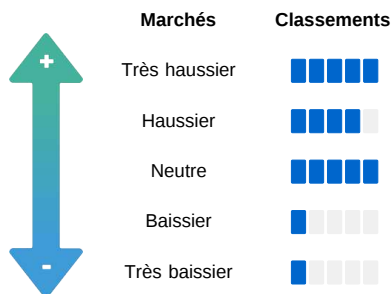
Historique base 100 du 29/08/2023 au 28/08/2026



Performance

Perf. 28/08/2026	Fonds	Catégorie
Perf. veille	0,34 %	0,33 %
Perf. 4 semaines	-1,37 %	-0,23 %
Perf. 1er janvier	-6,62 %	-5,21 %
Perf. 1 an	-7,51 %	-4,95 %
Perf. 3 ans	5,79 %	6,83 %
Perf. 5 ans	12,43 %	12,69 %
Perf. 8 ans	50,69 %	52,50 %
Perf. 10 ans	63,73 %	79,70 %
Performances annuelles		
Perf. 2025	-17,24 %	-13,54 %
Perf. 2024	24,08 %	20,29 %
Perf. 2023	21,61 %	16,19 %
Données 3 ans au 31/07/2026		
Perf. ann.	3,04 %	2,59 %
Volatilité	16,46 %	14,29 %
Sharpe	0,01	-0,02

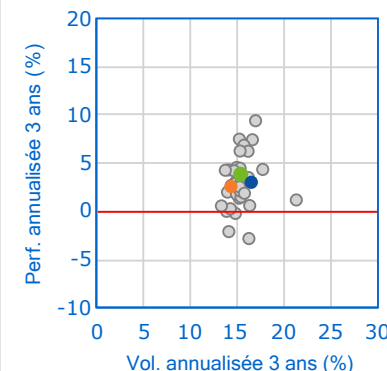
Baromètre Quantalys



Classement de la performance au 31/07/2026

	Rang	Quartile
1 mois	42 / 81	3
3 mois	13 / 81	1
6 mois	23 / 80	2
YTD	37 / 80	2
1 an	61 / 78	4
3 ans	24 / 61	2
5 ans	29 / 57	2
8 ans	19 / 38	2
10 ans	22 / 32	3

Fonds versus catégorie



Indicateurs de risque

Valeurs à 3 ans	Par rapport à la cat
Volatilité	16,46 %
Perte max	-34,84 %
DSR	11,58 %
Beta bais.	1,06
VAR	-3,59 %

SRI	1	2	3	4	5	6	7
-----	---	---	---	---	---	---	---

L'œil de l'expert

Valeurs à 3 ans	Par rapport à la cat
Sharpe	0,01
Ratio d'info.	-0,15
Sortino	0,01
Omega	1,04
Calmar	0,00

Caractéristiques générales

Type	OEIC
Capi/Distri	Capitalisation
Part couverte	Non
Fonds de fonds	Non
Eligible PEA	Non
Eligible PEA PME	Non
Actif au 28/08/2026	32,98 M
Variation de l'actif 3 mois	-1,53 %
Frais maximum	
Souscription	4 %
Rachat	Néant
Gestion	1,75 %
Surperformance	Néant
Frais courants	2 %
Frais de gestion PRIIPS	2 %
Frais de transaction	0,33 %

© 2026 Quantalys. Les informations contenues dans cette fiche appartiennent à Quantalys qui ne garantit ni leur fiabilité, ni leur exhaustivité. Cette fiche fonds vous est fournie à titre indicatif exclusivement par la société Quantalys. Elle ne constitue pas de la part de Quantalys une offre d'achat, de vente, de souscription ou de services financiers, ni une sollicitation d'une offre d'achat de quelque produit d'investissement que ce soit. Lisez le prospectus du fonds avant toute décision d'investissement. Les performances passées ne préjugent pas des performances futures. La notation Quantalys, les indicateurs, le comportement, la position du fonds par rapport à sa catégorie sont en date du 31/07/2026. Toutes les performances et données liées sont calculées en euro et ne sont pas garanties, notamment dans le cas de fonds libellés dans une devise différente de l'euro.



Fiche d'identité - FF Japan Value Fund A EUR Hedged - LU0611489658

Société	FIL Investment Management (Lux) SA
Type d'investisseur	Tous souscripteurs
Classification AMF	-
Indice de référence	Topix Total Return Index
Catégorie Quantalys	Actions Japon
Indice de réf. Quantalys	MSCI Japan NR
Gérant	Min Zeng
Evaluation ISR globale	SFDR
	Article 8
E S G	

Valeur liquidative

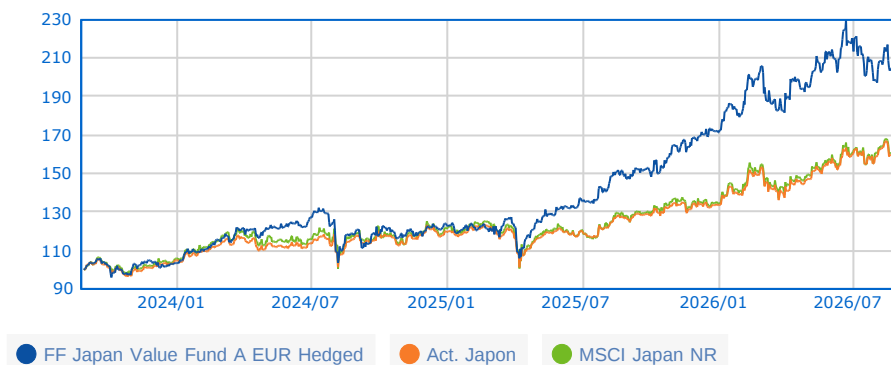
63,00 EUR

28/08/2026



Notation Quantalys

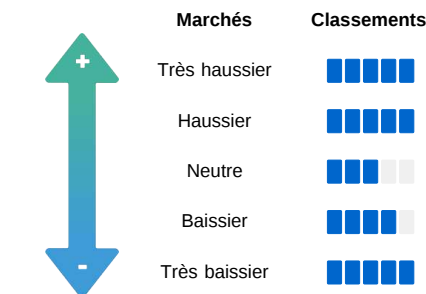
Historique base 100 du 29/08/2023 au 28/08/2026



Performance

Perf. 28/08/2026	Fonds	Catégorie
Perf. veille	0,85 %	0,58 %
Perf. 4 semaines	6,22 %	2,54 %
Perf. 1er janvier	22,93 %	21,80 %
Perf. 1 an	40,53 %	27,55 %
Perf. 3 ans	110,63 %	62,72 %
Perf. 5 ans	183,58 %	60,59 %
Perf. 8 ans	246,88 %	95,00 %
Perf. 10 ans	384,79 %	137,52 %
Performances annuelles		
Perf. 2025	39,61 %	11,48 %
Perf. 2024	18,58 %	14,22 %
Perf. 2023	33,30 %	14,44 %
Données 3 ans au 31/07/2026		
Perf. ann.	25,52 %	15,59 %
Volatilité	21,36 %	15,27 %
Sharpe	1,06	0,83

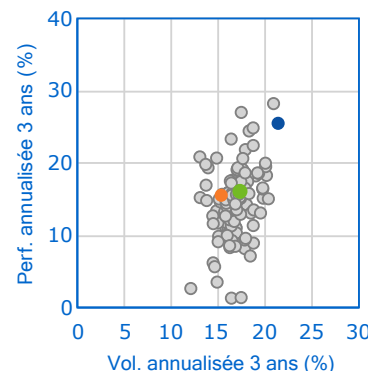
Baromètre Quantalys



Classement de la performance au 31/07/2026

	Rang	Quartile
1 mois	224 / 225	4
3 mois	223 / 225	4
6 mois	196 / 222	4
YTD	180 / 222	4
1 an	132 / 219	3
3 ans	48 / 187	2
5 ans	30 / 172	1
8 ans	18 / 130	1
10 ans	14 / 103	1

Fonds versus catégorie



Indicateurs de risque

Valeurs à 3 ans	Par rapport à la cat
Volatilité	21,36 % Très mauvais
Perte max	-21,65 % Très bon
DSR	14,96 % Très mauvais
Beta bais.	1,03 Moyen
VAR	-3,55 % Très mauvais

SRI	1	2	3	4	5	6	7
-----	---	---	---	---	---	---	---

L'œil de l'expert

Valeurs à 3 ans	Par rapport à la cat
Sharpe	1,06 Mauvais
Ratio d'info.	0,58 Bon
Sortino	1,51 Mauvais
Omega	1,51 Moyen
Calmar	1,02 Très bon

Caractéristiques générales

Type	SICAV
Capi/Distri	Distribution
Part couverte	Oui
Fonds de fonds	Non
Eligible PEA	Non
Eligible PEA PME	Non
Actif au 28/08/2026	264,91 M
Variation de l'actif 3 mois	-14,02 %
Frais maximum	
Souscription	5,25 %
Rachat	Néant
Gestion	1,5 %
Surperformance	Néant
Frais courants	1,89 %
Frais de gestion PRIIPS	1,91 %
Frais de transaction	0,2 %

© 2026 Quantalys. Les informations contenues dans cette fiche appartiennent à Quantalys qui ne garantit ni leur fiabilité, ni leur exhaustivité. Cette fiche fonds vous est fournie à titre indicatif exclusivement par la société Quantalys. Elle ne constitue pas de la part de Quantalys une offre d'achat, de vente, de souscription ou de services financiers, ni une sollicitation d'une offre d'achat de quelque produit d'investissement que ce soit. Lisez le prospectus du fonds avant toute décision d'investissement. Les performances passées ne préjugent pas des performances futures. La notation Quantalys, les indicateurs, le comportement, la position du fonds par rapport à sa catégorie sont en date du 31/07/2026. Toutes les performances et données liées sont calculées en euro et ne sont pas garanties, notamment dans le cas de fonds libellés dans une devise différente de l'euro.

Valeur liquidative

68,16 EUR

31/08/2026

Evaluation ISR globale

SFDR

E S G

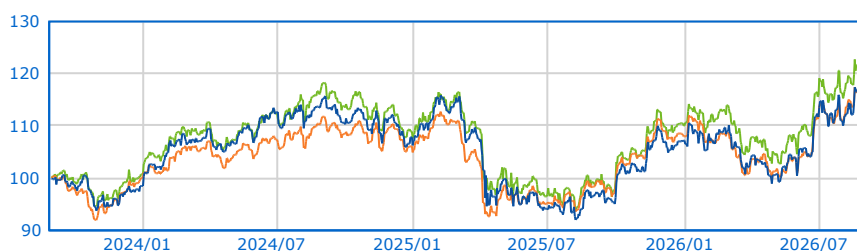
Article 8

Article 8



Notation Quantalys

Performance



● BGF World Healthscience Fund A2 EUR ● Act. Sect. Santé-Pharmacie

● MSCI World Health Care NR

Perf. 31/08/2026

Perf. 1er janv 2020	Catégorie
Perf. veille	-0,83 %
Perf. 4 semaines	3,82 %
Perf. 1er janvier	6,57 %
Perf. 1 an	18,27 %
Perf. 3 ans	14,23 %
Perf. 5 ans	21,52 %
Perf. 8 ans	78,15 %
Perf. 10 ans	120,44 %

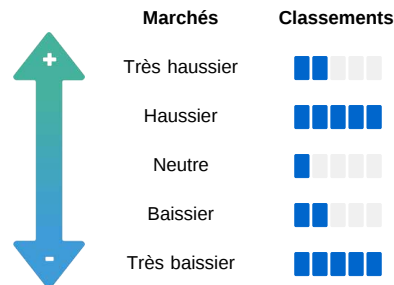
Performances annuelles

Perf. 2025	0,06 %	2,42 %
Perf. 2024	8,74 %	5,33 %
Perf. 2023	-1,33 %	-1,39 %

Données 3 ans au 31/07/2026

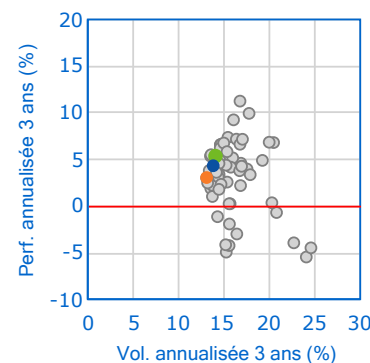
Perf. ann.	4,36 %	3,09 %
Volatilité	13,76 %	13,03 %
Sharpe	0.11	0.01

Classement de la performance au 31/07/2026



	Rang	Quartile
1 mois	93 / 135	3 
3 mois	59 / 135	2 
6 mois	64 / 134	2 
YTD	70 / 134	3 
1 an	72 / 134	3 
3 ans	50 / 121	2 
5 ans	30 / 105	2 
8 ans	17 / 60	2 
10 ans	16 / 49	2 

Fonds versus catégorie



L'œil de l'expert

Valeurs à 3 ans	Par rapport à la cat
Volatilité 13,76 %	Bon
Perte max -20,53 %	Très bon
DSR 9,67 %	Bon
Beta bais. 0,81	Moyen
VAR -3,07 %	Bon

Valeurs à 3 ans		Par rapport à la cat	
Sharpe	0,11		Bon
Ratio d'info.	-0,17		Moyen
Sortino	0,15		Bon
Omega	1,07		Moyen
Calmar	0,07		Bon

Caractéristiques générales

Type	SICAV
Capi/Distri	Capitalisation
Part couverte	Non
Fonds de fonds	Non
Eligible PEA	Oui
Eligible PEA PME	Non
Actif au 19/08/2026	
Variation de l'actif 3 mois	-
Frais maximum	
Souscription	5 %
Rachat	Néant
Gestion	1,5 %
Surperformance	Néant
Frais courants	1,8 %
Frais de gestion PRIIPS	1,81 %
Frais de transaction	0,31 %

© 2026 Quantalys. Les informations contenues dans cette fiche appartiennent à Quantalys qui ne garantit ni leur fiabilité, ni leur exhaustivité. Cette fiche fonds vous est fournie à titre indicatif exclusivement par la société Quantalys. Elle ne constitue pas de la part de Quantalys une offre d'achat, de vente, de souscription ou de services financiers, ni une sollicitation d'une offre d'achat de quelque produit d'investissement que ce soit. Lisez le prospectus du fonds avant toute décision d'investissement. Les performances passées ne préjugent pas des performances futures. La notation Quantalys, les indicateurs, le comportement, la position du fonds par rapport à sa catégorie sont en date du 31/07/2026. Toutes les performances et données liées sont calculées en euro et ne sont pas garanties, notamment dans le cas de fonds libellés dans une devise différente de l'euro.



Fiche d'identité - BGF World Technology Fund A2 EUR - LU0171310443

Société	BlackRock (Luxembourg) S.A.
Société déléguée	Blackrock Investment Management LLC
Type d'investisseur	Tous souscripteurs
Classification AMF	-
Indice de référence	MSCI AC World Information Technology 10/40 Index
Catégorie Quantalys	Actions Sectorielles Technologies
Indice de réf. Quantalys	MSCI World Information Tech NR
Gérant	Tony Kim
Evaluation ISR globale	SFDR
	Article 8



Valeur liquidative

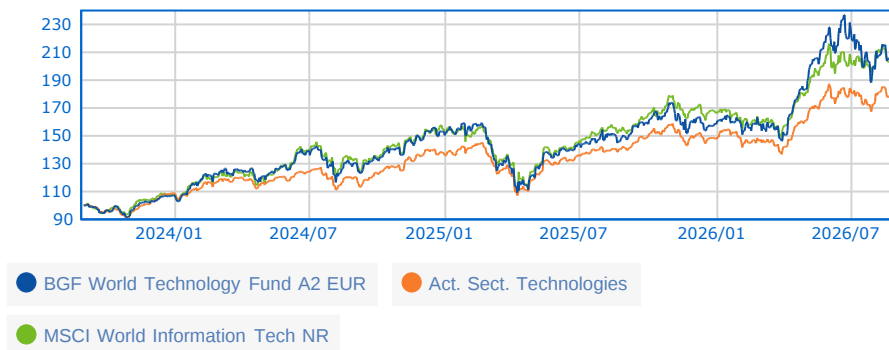
125,60 EUR

31/08/2026



Notation Quantalys

Historique base 100 du 01/09/2023 au 31/08/2026



Performance

Perf. 31/08/2026	Fonds	Catégorie
Perf. veille	-0,51 %	-1,35 %
Perf. 4 semaines	5,28 %	1,92 %
Perf. 1er janvier	31,24 %	20,31 %
Perf. 1 an	39,12 %	25,57 %
Perf. 3 ans	107,95 %	77,62 %
Perf. 5 ans	70,86 %	49,90 %
Perf. 8 ans	301,02 %	184,18 %
Perf. 10 ans	633,22 %	320,15 %
Performances annuelles		
Perf. 2025	4,40 %	8,62 %
Perf. 2024	41,36 %	24,83 %
Perf. 2023	44,66 %	35,80 %
Données 3 ans au 31/07/2026		
Perf. ann.	25,88 %	18,67 %
Volatilité	24,58 %	18,70 %
Sharpe	0,94	0,84

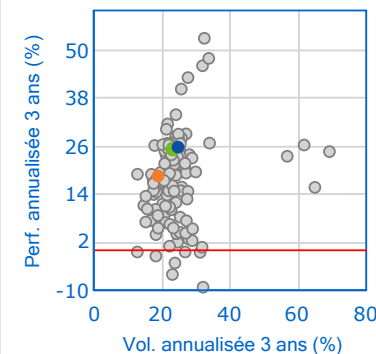
Baromètre Quantalys

Marchés	Classements
Très haussier	■■■■■
Haussier	■■■■■
Neutre	■■■■■
Baissier	■■■■■
Très baissier	■■■■■

Classement de la performance au 31/07/2026

	Rang	Quartile
1 mois	254 / 311	4 ■■■■
3 mois	115 / 308	2 ■■■■
6 mois	77 / 304	2 ■■■■
YTD	69 / 304	1 ■■■■
1 an	76 / 299	2 ■■■■
3 ans	38 / 259	1 ■■■■
5 ans	47 / 184	2 ■■■■
8 ans	13 / 80	1 ■■■■
10 ans	10 / 54	1 ■■■■

Fonds versus catégorie



Indicateurs de risque

Valeurs à 3 ans	Par rapport à la cat
Volatilité	24,58 % ■■■■ Mauvais
Perte max	-31,30 % ■■■■ Mauvais
DSR	16,42 % ■■■■ Mauvais
Beta bais.	0,98 ■■■■ Mauvais
VAR	-5,28 % ■■■■ Mauvais

SRI	1	2	3	4	5	6	7
-----	---	---	---	---	---	---	---

L'œil de l'expert

Valeurs à 3 ans	Par rapport à la cat
Sharpe	0,94 ■■■■ Bon
Ratio d'info.	0,04 ■■■■ Moyen
Sortino	1,40 ■■■■ Bon
Omega	1,43 ■■■■ Bon
Calmar	0,72 ■■■■ Bon

Caractéristiques générales

Type	SICAV
Capi/Distri	Capitalisation
Part couverte	Non
Fonds de fonds	Non
Eligible PEA	Non
Eligible PEA PME	Non
Actif au 19/08/2026	-
Variation de l'actif 3 mois	-
Frais maximum	
Souscription	5 %
Rachat	Néant
Gestion	1,5 %
Surperformance	Néant
Frais courants	1,8 %
Frais de gestion PRIIPS	1,81 %
Frais de transaction	0,43 %

© 2026 Quantalys. Les informations contenues dans cette fiche appartiennent à Quantalys qui ne garantit ni leur fiabilité, ni leur exhaustivité. Cette fiche fonds vous est fournie à titre indicatif exclusivement par la société Quantalys. Elle ne constitue pas de la part de Quantalys une offre d'achat, de vente, de souscription ou de services financiers, ni une sollicitation d'une offre d'achat de quelque produit d'investissement que ce soit. Lisez le prospectus du fonds avant toute décision d'investissement. Les performances passées ne préjugent pas des performances futures. La notation Quantalys, les indicateurs, le comportement, la position du fonds par rapport à sa catégorie sont en date du 31/07/2026. Toutes les performances et données liées sont calculées en euro et ne sont pas garanties, notamment dans le cas de fonds libellés dans une devise différente de l'euro.



Fiche d'identité - Pictet Gbl Env Opp P EUR Acc - LU0503631714

Société	Pictet Asset Management (Europe) SA
Société déléguée	Pictet Asset Management (Geneve) SA
Type d'investisseur	Tous souscripteurs
Classification AMF	-
Indice de référence	MSCI AC World (EUR)
Catégorie Quantalys	Actions Sectorielles Environnement
Indice de réf. Quantalys	MSCI World NR
Gérant	Luciano Diana (2014-08-26), Katie Self (2022-10-01), Chris Elias (2025-03-01), Nadine Hayderi (2025-03-01), Yi Du (2018-09-01)

Valeur liquidative

379,80 EUR

31/08/2026

Evaluation ISR globale



Labels



SFDR

Article 9



Notation Quantalys

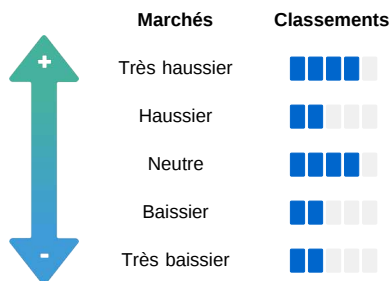
Historique base 100 du 01/09/2023 au 31/08/2026



Performance

Perf. 31/08/2026	Fonds	Catégorie
Perf. veille	-0,82 %	-0,78 %
Perf. 4 semaines	0,35 %	-0,07 %
Perf. 1er janvier	14,72 %	12,82 %
Perf. 1 an	12,41 %	17,43 %
Perf. 3 ans	21,98 %	32,37 %
Perf. 5 ans	13,59 %	17,86 %
Perf. 8 ans	93,48 %	80,82 %
Perf. 10 ans	132,48 %	111,23 %
Performances annuelles		
Perf. 2025	-6,66 %	6,67 %
Perf. 2024	8,95 %	7,61 %
Perf. 2023	14,95 %	8,20 %
Données 3 ans au 31/07/2026		
Perf. ann.	6,24 %	8,35 %
Volatilité	14,45 %	12,38 %
Sharpe	0,23	0,44

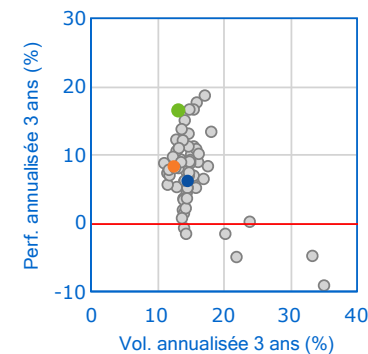
Baromètre Quantalys



Classement de la performance au 31/07/2026

	Rang	Quartile
1 mois	92 / 115	4
3 mois	39 / 115	2
6 mois	42 / 115	2
YTD	38 / 115	2
1 an	89 / 114	4
3 ans	69 / 106	3
5 ans	47 / 90	3
8 ans	11 / 41	1
10 ans	6 / 24	1

Fonds versus catégorie



Indicateurs de risque

Valeurs à 3 ans	Par rapport à la cat
Volatilité	14,45 % Moyen
Perte max	-22,03 % Mauvais
DSR	10,13 % Moyen
Beta bais.	0,68 Moyen
VAR	-3,28 % Mauvais

SRI	1	2	3	4	5	6	7
-----	---	---	---	---	---	---	---

L'œil de l'expert

Valeurs à 3 ans	Par rapport à la cat
Sharpe	0,23 Mauvais
Ratio d'info.	-1,08 Très mauvais
Sortino	0,33 Mauvais
Omega	1,13 Mauvais
Calmar	0,15 Mauvais

Caractéristiques générales

Type	SICAV
Capi/Distri	Capitalisation
Part couverte	Non
Fonds de fonds	Non
Eligible PEA	Non
Eligible PEA PME	Non
Actif au 31/08/2026	465,75 M
Variation de l'actif 3 mois	-3,98 %
Frais maximum	
Souscription	5 %
Rachat	1 %
Gestion	2,4 %
Surperformance	Néant
Frais courants	1,99 %
Frais de gestion PRIIPS	1,99 %
Frais de transaction	0,06 %

© 2026 Quantalys. Les informations contenues dans cette fiche appartiennent à Quantalys qui ne garantit ni leur fiabilité, ni leur exhaustivité. Cette fiche fonds vous est fournie à titre indicatif exclusivement par la société Quantalys. Elle ne constitue pas de la part de Quantalys une offre d'achat, de vente, de souscription ou de services financiers, ni une sollicitation d'une offre d'achat de quelque produit d'investissement que ce soit. Lisez le prospectus du fonds avant toute décision d'investissement. Les performances passées ne préjugent pas des performances futures. La notation Quantalys, les indicateurs, le comportement, la position du fonds par rapport à sa catégorie sont en date du 31/07/2026. Toutes les performances et données liées sont calculées en euro et ne sont pas garanties, notamment dans le cas de fonds libellés dans une devise différente de l'euro.



Fiche d'identité - Pictet Robotics P EUR Acc - LU1279334210

Société	Pictet Asset Management (Europe) SA
Société déléguée	Pictet Asset Management (Geneve) SA
Type d'investisseur	Tous souscripteurs
Classification AMF	-
Indice de référence	MSCI AC World (USD)
Catégorie Quantalys	Actions Sectorielles Technologies
Indice de réf. Quantalys	MSCI World Information Tech NR
Gérant	Peter Lingen (2016-01-01), Daegal Tsang (2022-08-01), Francesco Pighini (2019-05-01), Stanislas Buiatti (2023-04-01)

Evaluation ISR globale



Labels



SFDR

Article 8

Valeur liquidative

524,74 EUR

31/08/2026



Notation Quantalys

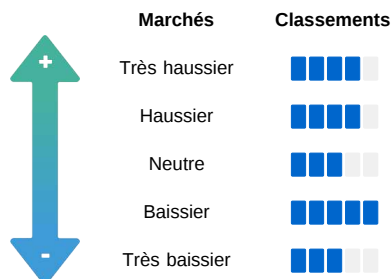
Historique base 100 du 01/09/2023 au 31/08/2026



Performance

Perf. 31/08/2026	Fonds	Catégorie
Perf. veille	-0,45 %	-1,35 %
Perf. 4 semaines	9,93 %	1,92 %
Perf. 1er janvier	30,39 %	20,31 %
Perf. 1 an	46,86 %	25,57 %
Perf. 3 ans	99,60 %	77,62 %
Perf. 5 ans	93,15 %	49,90 %
Perf. 8 ans	263,32 %	184,18 %
Perf. 10 ans	426,95 %	320,15 %
Performances annuelles		
Perf. 2025	9,94 %	8,62 %
Perf. 2024	22,81 %	24,83 %
Perf. 2023	47,66 %	35,80 %
Données 3 ans au 31/07/2026		
Perf. ann.	20,36 %	18,67 %
Volatilité	23,55 %	18,70 %
Sharpe	0,74	0,84

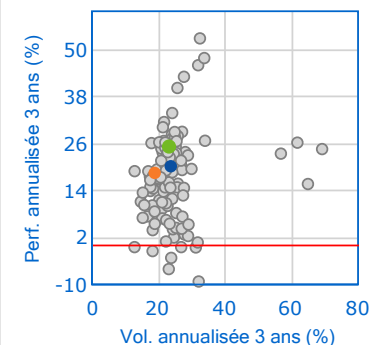
Baromètre Quantalys



Classement de la performance au 31/07/2026

	Rang	Quartile
1 mois	81 / 311	2
3 mois	25 / 308	1
6 mois	143 / 304	2
YTD	154 / 304	3
1 an	80 / 299	2
3 ans	113 / 259	2
5 ans	40 / 184	1
8 ans	32 / 80	2
10 ans	27 / 54	2

Fonds versus catégorie



Indicateurs de risque

Valeurs à 3 ans	Par rapport à la cat
Volatilité	23,55 % Mauvais
Perte max	-31,88 % Mauvais
DSR	16,24 % Mauvais
Beta bais.	0,99 Très mauvais
VAR	-5,51 % Mauvais

SRI	1	2	3	4	5	6	7
-----	---	---	---	---	---	---	---

L'œil de l'expert

Valeurs à 3 ans	Par rapport à la cat
Sharpe	0,74 Moyen
Ratio d'info.	-0,33 Moyen
Sortino	1,08 Moyen
Omega	1,37 Moyen
Calmar	0,53 Moyen

Caractéristiques générales

Type	SICAV
Capi/Distri	Capitalisation
Part couverte	Non
Fonds de fonds	Non
Eligible PEA	Non
Eligible PEA PME	Non
Actif au 31/08/2026	1 305,22 M
Variation de l'actif 3 mois	11,83 %
Frais maximum	
Souscription	5 %
Rachat	1 %
Gestion	2,4 %
Surperformance	Néant
Frais courants	1,98 %
Frais de gestion PRIIPS	1,98 %
Frais de transaction	0,08 %

© 2026 Quantalys. Les informations contenues dans cette fiche appartiennent à Quantalys qui ne garantit ni leur fiabilité, ni leur exhaustivité. Cette fiche fonds vous est fournie à titre indicatif exclusivement par la société Quantalys. Elle ne constitue pas de la part de Quantalys une offre d'achat, de vente, de souscription ou de services financiers, ni une sollicitation d'une offre d'achat de quelque produit d'investissement que ce soit. Lisez le prospectus du fonds avant toute décision d'investissement. Les performances passées ne préjugent pas des performances futures. La notation Quantalys, les indicateurs, le comportement, la position du fonds par rapport à sa catégorie sont en date du 31/07/2026. Toutes les performances et données liées sont calculées en euro et ne sont pas garanties, notamment dans le cas de fonds libellés dans une devise différente de l'euro.

Valeur liquidative

280,56 EUR

28/08/2026

Evaluation ISR globale

SFDR

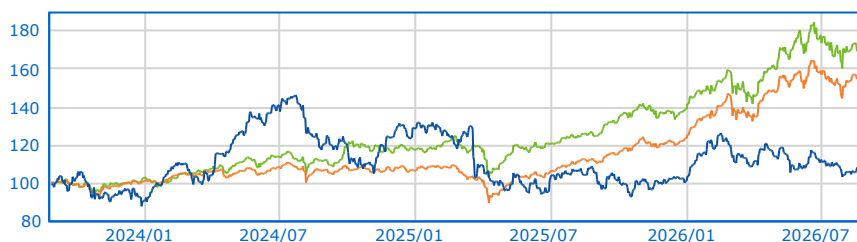
Article 8

Article 8



Notation Quantalys

Performance



BNPP Turkey Equity Classic EUR Acc

- Act. Pays Emerg. autres pays

● MSCI Emerging Markets NR

Perf. 28/08/2026

Fonds	Catégorie
-------	-----------

Perf. veille	0,44 %	0,01 %
Perf. 4 semaines	5,11 %	5,30 %
Perf. 1er janvier	8,27 %	28,33 %
Perf. 1 an	2,30 %	41,30 %
Perf. 3 ans	9,82 %	58,99 %
Perf. 5 ans	125,64 %	76,03 %
Perf. 8 ans	167,05 %	114,61 %
Perf. 10 ans	51,21 %	123,73 %

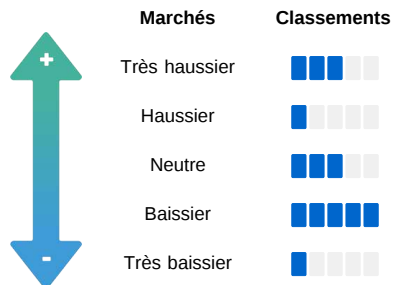
Performances annuelles

Perf. 2025	-21,37 %	16,03 %
Perf. 2024	41,86 %	5,48 %
Perf. 2023	9,40 %	8,87 %

Données 3 ans au 31/07/2026

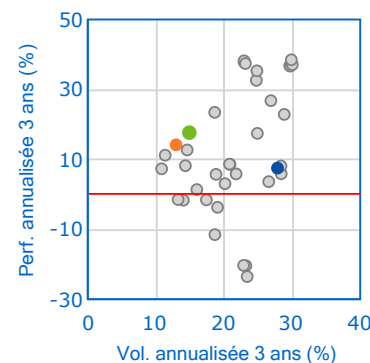
Perf. ann.	7,59 %	14,23 %
Volatilité	27,82 %	12,88 %
Sharpe	0.17	0.88

Classement de la performance au 31/07/2026



	Rang	Quartile
1 mois	25 / 47	3 
3 mois	37 / 47	4 
6 mois	40 / 47	4 
YTD	35 / 47	3 
1 an	38 / 46	4 
3 ans	25 / 44	3 
5 ans	6 / 43	1 
8 ans	14 / 36	2 
10 ans	22 / 33	3 

Fonds versus catégorie



L'œil de l'expert

Valeurs à 3 ans		Par rapport à la cat	
Volatilité	27,82 %		Mauvais
Perte max	-36,34 %		Très mauvais
DSR	20,03 %		Très mauvais
Beta bais.	0,35		Très bon
VAR	-5.15 %		Moyen

SRI	1	2	3	4	5	6	7
-----	---	---	---	---	---	---	---

Valeurs à 3 ans		Par rapport à la cat	
Sharpe	0,17		Moyen
Ratio d'info.	-0,35		Moyen
Sortino	0,23		Moyen
Omega	1,10		Mauvais
Calmar	0,13		Moyen

Caractéristiques générales

Type	SICAV
Capi/Distri	Capitalisation
Part couverte	Non
Fonds de fonds	Non
Eligible PEA	Non
Eligible PEA PME	Non
Actif au 28/08/2026	19,10 M
Variation de l'actif 3 mois	-4,34 %
Frais maximum	
Souscription	3 %
Rachat	Néant
Gestion	1,75 %
Surperformance	Néant
Frais courants	2,21 %
Frais de gestion PRIIPS	2,21 %
Frais de transaction	0,66 %

**Code ISIN**

Identifiant à 12 caractères, dont les 2 premiers indiquent le pays de domiciliation du fonds. Sert à identifier le fonds et à passer les ordres d'achat et de vente. Dans le cas des fonds d'épargne salariale, il s'agit du code AMF, également composé de 12 caractères, qui sont tous des chiffres. Dans le cas où le produit n'a pas de code ISIN, nous attribuons un code commençant par QUA.

DSR (Downside Risk)

La volatilité considère les écarts de performance négatifs comme positifs par rapport à la performance moyenne du fonds, alors que l'investisseur n'est généralement concerné que par les performances inférieures à un certain seuil. Le downside risk (DSR) ne va prendre en compte que les rendements inférieurs à ce seuil pour en calculer la volatilité. Nous utilisons l'EONIA, qui mesure le taux de l'argent au jour le jour, et ne retenons que les rendements mensuels inférieurs à l'EONIA pour calculer le downside risk du fonds. Comme pour la volatilité classique, plus le downside risk est grand, plus la stratégie appliquée par le fonds est risquée.

Frais courants

Il s'agit des frais effectivement facturés à la part du fonds lors du dernier exercice comptable clôturé, ou d'une estimation des frais dans le cas d'une part n'ayant pas encore clôturé son premier exercice. Les frais courants correspondent à la somme des frais de gestion financière, des frais encourus au titre des investissements dans d'autres OPCVM et des commissions de mouvement. Ils n'incluent pas la commission de surperformance, qui est publiée séparément dans le DICI (document d'informations clés pour l'investisseur).

Notation Quantalys

La notation Quantalys est calculée tous les mois en utilisant des données sur les 3 dernières années. Le calcul est effectuée au sein de chaque catégorie notable et considère 3 dimensions : l'alpha du fonds par rapport à l'indice de sa catégorie, le beta du fonds (décomposé en beta haussier et beta baissier) et l'alpha du fonds par rapport à sa reconstitution statistique. La notation comprend 5 étoiles distribuées également (par tranche de 20%).

Performance cumulée

La performance cumulée d'une date donnée à une date postérieure correspond à l'évolution en pourcentage de la valeur liquidative du fonds entre ces deux dates. Si la valeur liquidative d'un fonds était de 100 à une date donnée et de 130 à une date postérieure, la performance cumulée sur la période est de 30%, soit $(130-100)/100$.

Perte Maximum

Il s'agit de la perte la plus importante encourue par le fonds sur la période, c'est-à-dire ce qui aurait été perdu si le fonds avait été acheté au plus haut et vendu au plus bas possible sur la période.

Ratio de Sharpe

Le ratio de Sharpe a pour numérateur la surperformance du fonds par rapport au taux sans risque (Quantalys utilise l'EONIA comme taux sans risque) et pour dénominateur le risque du fonds (mesuré par l'écart-type de ses rendements mensuels). Dans le cas où le fonds a généré une surperformance par rapport au taux sans risque (et donc où le Ratio de Sharpe est positif), plus le ratio de Sharpe est élevé, meilleur a été le fonds. Un ratio de Sharpe de 0.4 indique que le fonds a rapporté 0.4% de performance au delà du taux sans risque par unité de risque supplémentaire (soit pour 1% de volatilité, mesurée par l'écart-type des rendements du fonds sur la période de calcul).

Risque / Volatilité

Le risque est mesuré par l'écart-type des rendements hebdomadaires du fonds sur différentes périodes : 1 an, 3 ans, 5 ans, ou sur une période définie par l'utilisateur. On parle aussi parfois de volatilité. Plus le fonds est volatil, plus grande est la fourchette des performances possibles, qu'elles soient positives ou négatives. Toutes choses étant égales par ailleurs, moins le risque est élevé, meilleur a été le fonds pour l'investisseur, mais certains fonds ont à la fois un risque élevé et des performances passées excellentes, il faut donc savoir séparer le bon risque du mauvais risque.