

QO - Prudent Vs TUNINDEX :

QO - 5S-80 est un algorithme adoptant la même philosophie que **QO - 5S**, la différence réside dans le niveau d'exposition au marché. Adapté au **CEA** (Compte Epargne en Action), la poche action représente **80.00%** du total portefeuille. L'objectif, en terme de rendement, est d'obtenir **une performance non corrélée à celle du marché.**



Performances

Sur la période, s'étalant de Janvier 2010 à Décembre 2020, l'algorithme QO - 5 Stars - 80 a réalisé une performance de 136,86%, contre une performance du TUNINDEX de 47,26%. Cette performance est répartie annuellement comme l'indique le graphe ci-dessous :



Les années 2016, 2011, et 2015 ont connu des performances, à deux chiffres, qui ont été respectivement de 36.11%, 27.10%, et 15.79%. Tandis que les années 2013 et 2019 ont connu des performances respectives de -12.01% et -1.76%. Le TUNINDEX a réalisé courant ses deux années, 2013 et 2019, des performances respectives de l'ordre de -4.43% et -2.08%. Pour mieux analyser les performances de l'algorithme QO - 5 Stars - 80, nous passons aux ratios de gestion.

Ratios de Gestion :

QO-5S-80	1 Mois	3 Mois	6 Mois	YtD	1 An	2 Ans	3 Ans	5 Ans
Volatilité Annualisée	28,14%	22,81%	27,19%	23,81%	23,81%	31,44%	38,75%	45,14%
Tracking Error	1,09%	1,84%	1,61%	1,41%	1,31%	1,40%	1,34%	1,23%
Ratio d'Information	3,45	3,82	6,87	15,63	21,04	19,78	20,19	29,13
Beta	1,48	1,13	1,04	0,73	0,73	0,70	0,68	0,68
Ratio Treynor	10,76%	12,65%	21,97%	49,00%	48,98%	53,81%	50,92%	84,15%
Ratio de Sharpe	9,17	10,16	13,58	14,56	16,58	11,41	13,66	33,60
Alpha de Jensen	19,27%	15,07%	22,88%	32,93%	32,98%	33,48%	35,15%	64,54%