

## QO - Prudent Vs TUNINDEX :

**QO - Dynamic**, est un algorithme créé pour les investisseurs **peu averse au risque**, et aux portefeuilles **CEA (Compte Epargne en Actions)**. La proportion action investie dans le portefeuille est de **80.00%**. Le rebalancing du portefeuille est effectué quotidiennement pour sélectionner les titres dont les **tendances sont haussières**. Les objectifs de gestion de **QO - Dynamic**, sont une **forte exposition au marché**, tout en étant **non corrélé au marché**. **QO - Dynamic** se focalise essentiellement sur la création de richesse, impliquant aussi une **volatilité supérieure** à celle du marché.



## Performances

Sur la période, s'étalant de Janvier 2010 à Décembre 2020, l'algorithme QO - Dynamic a réalisé une performance de 76.64%, contre une performance du TUNINDEX de 47.26%. Cette performance est répartie annuellement comme l'indique le graphe ci-dessous :



Les années 2018, 2011 et 2016 ont connu les meilleures performances qui ont été respectivement de 26.03%, 25.99% et 17.53%. Tandis que les années 2013 et 2019 ont connu des performances respectives de -22.96% et -15.51%. 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 - Dynamic, nous passons aux ratios de gestion.

## Ratios de Gestion :

QO-Dynamic	1 Mois	3 Mois	6 Mois	YtD	1 An	2 Ans	3 Ans	5 Ans
Volatilité Annualisée	10,40%	9,88%	11,73%	13,14%	13,14%	17,35%	25,33%	29,27%
Tracking Error	0,35%	0,51%	0,66%	0,69%	0,66%	0,87%	0,84%	0,79%
Ratio d'Information	0,10	4,56	-2,42	8,55	12,93	-5,48	7,08	10,45
Beta	1,12	1,07	0,82	0,75	0,75	0,65	0,72	0,73
Ratio Treynor	4,20%	3,57%	11,36%	13,67%	13,69%	-4,06%	11,30%	21,89%
Ratio de Sharpe	7,59	6,53	13,21	-4,70	-1,04	-30,98	-7,54	2,31
Alpha de Jensen	5,54%	4,24%	8,65%	7,51%	7,51%	-7,21%	8,75%	22,30%