



QUANTOPT

Présentation et analyse : QO - Prudent

Echelle de risque

1

2

3

4

5

6

7

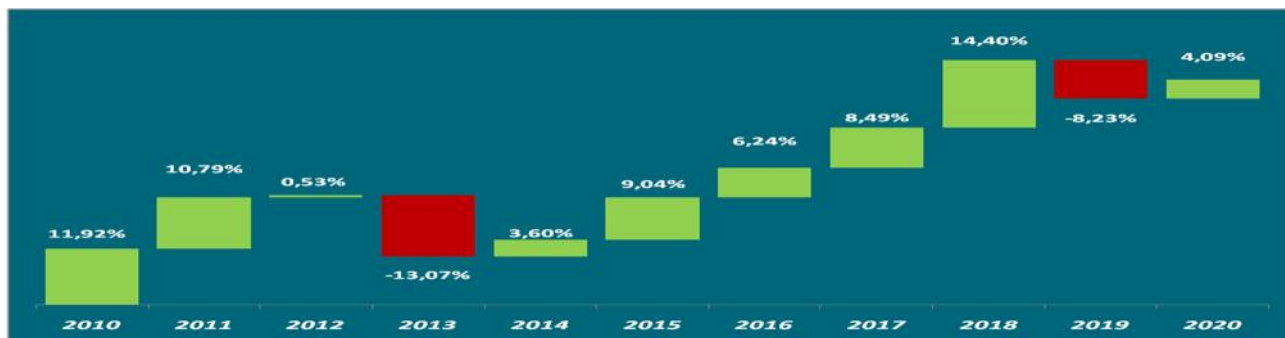
QO - Prudent Vs TUNINDEX :

QO - Prudent est un algorithme adapté à tous les profils de risques. La proportion du portefeuille investi en actions est déterminé par l'algorithme, pouvant varier entre un maximum de **80.00%** et un minimum de **0.00%**. Selon le niveau de risque **QO - Prudent** fixe la pondération de la poche action et au sein de la poche action détermine les valeurs à détenir. Le rebalancing du portefeuille est effectué quotidiennement pour anticiper la tendance et le risque encouru par le portefeuille. En terme d'objectif de gestion, **QO - Prudent** se concentre sur la **minimisation du risque**, que ce soit en terme de **diversification** ou bien en terme **d'exposition au marché**, tout en gardant un objectif **rendement**.



Performances

Sur la période, s'étalant de Janvier 2010 à Décembre 2020, l'algorithme QO - Prudent a réalisé une performance de 47.80%, contre une performance du TUNINDEX de 47.26%. Cette performance est répartie annuellement comme l'indique le graphique ci-dessous:



Les années 2018, 2010 et 2011 ont connu les meilleures performances qui ont été respectivement de 14.40%, 11.92% et 10.79%. Tandis que les années 2013 et 2019 ont connu des performances respectives de -13.07% et -8.23%. 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 - Prudent, nous passons aux ratios de gestion.

Ratios de Gestion :

QO -Prudent	1 Mois	3 Mois	6 Mois	YtD	1 An	2 Ans	3 Ans	5 Ans
Volatilité Annualisée	5,11%	6,00%	8,60%	7,48%	7,48%	9,26%	11,77%	14,19%
Tracking Error	0,24%	0,36%	0,44%	0,57%	0,53%	0,48%	0,43%	0,39%
Ratio d'Information	2,02	2,84	2,42	14,20	12,71	7,24	5,64	-11,25
Beta	0,93	0,91	0,74	0,42	0,42	0,40	0,50	0,51
Ratio Treynor	0,89%	-0,22%	3,15%	17,85%	17,98%	3,86%	1,42%	-11,99%
Ratio de Sharpe	3,31	0,07	5,09	-14,24	-7,81	-47,91	-33,49	-50,44
Alpha de Jensen	0,31%	-0,72%	1,38%	1,00%	0,97%	-6,23%	1,84%	5,22%