

Ambiose - C

FR0010250142

Fiche Produit | 31/01/2012

Ambiose - C

Actions Zone Euro

Positionnement

Style de gestion

Discrétionnaire	Hybride	Systématique
Value	Mixte	Growth

Capitalisations boursières

Small	Mid	Large
	\$1mds	\$5mds

(Capitalisations boursières en milliards de USD)

Risque actif

Faible	Moyen	Elevé	Très élevé
	5%	10%	15%

(Tracking-error annualisée moyenne attendue)

Concentration

Très élevée	20	40	60	80	100	120	140	Très faible
-------------	----	----	----	----	-----	-----	------------	-------------

(Nombre de cible de titres en portefeuille)

Statistiques

Volatilité du fonds (2)	25.74
Tracking-Error (2)	5.09
Ratio de Sharpe (2)	-0.97
% mois positifs	55.10
(2) période : depuis le 29/12/2003	

Gérant

Guillaume GARCHERY a rejoint AFIM en septembre 2009. Guillaume débuta sa carrière au sein de la Société Générale CIB en 2006 en tant que trader quantitatif dans l'équipe d'arbitrage statistique. Il était en charge du développement et de l'application de stratégies basse fréquence sur les actions européennes. Guillaume est titulaire d'un M2 en Probabilités et Finance (Université Paris VI), d'un M1 en Mathématiques générales (École Normale Supérieure de Lyon) et de l'agrégation externe de Mathématiques.

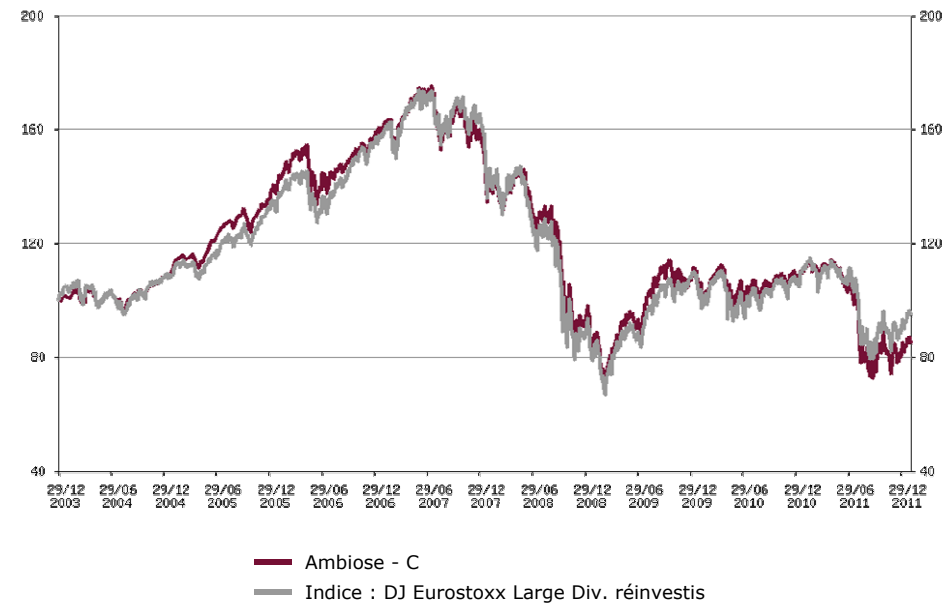
Contact & Informations

Avenir Finance IM
53 rue La Boétie
75008 Paris - FR
<http://im.avenirfinance.fr>
+33 1 70 08 08 00
contact@avenirfinance.fr

Objectif

Ambiose cherche à maximiser le rendement à moyen/long terme d'un portefeuille d'actions européennes. Le fonds a pour objectif d'offrir une performance régulière supérieure à celle de l'indice EURO STOXX LARGE (dividendes réinvestis) par le biais d'une gestion dynamique.

Performances Cumulées (%)



Performances (%)

Performances	Fonds	Indice	Ecart
1 mois	3.99	5.00	- 1.02
6 mois	- 15.09	- 8.48	- 6.61
1 an	- 22.92	- 14.09	- 8.83
2012 YTD	3.99	5.00	- 1.02
2011	- 23.55	- 14.20	- 9.35
2010	0.28	- 2.05	2.33
2009	14.77	21.28	- 6.51
2008	- 41.59	- 46.28	4.69
2007	1.58	6.53	- 4.96
2006	16.70	17.95	- 1.24
2005	24.56	21.88	2.69
2004	8.23	7.43	0.81
Origine (1)	- 13.90	- 4.90	- 9.00

Stratégie de gestion

L'objectif est de générer, selon une stratégie qui repose sur l'élaboration de modèles mathématiques, une performance régulière en combinant plusieurs approches pour la sélection des titres : la sensibilité aux facteurs macroéconomiques, la valorisation et la dynamique des cours. Chacune de ces approches utilise des filtres quantitatifs qui permettent d'évaluer l'ensemble de l'univers éligible.

La construction du portefeuille prend en compte le risque relatif par rapport au benchmark et la diversification naturelle résultant des différents critères de sélection des titres.

La gestion, dynamique, utilise également des contrats futures sur indices actions européens, avec pour objectif principal de protéger le portefeuille dans les marchés baissiers, dans la limite d'une exposition minimale aux marchés actions de 60 %.

Caractéristiques

Forme juridique

FCP à vocation générale

Date de création

24/12/2003

Classification AMFAction des pays de la
Communauté Européenne**Indice de référence**DJ Eurostoxx Large Div.
réinvestis**Devise d'expression**

EUR

Liquidité

Quotidien avant 10:00 (Paris)

Règlement

J+2

Commission de souscription

4.75%

Commission de rachat

Néant

Frais de gestion fixes

2.150%

Frais de gestion variables

N/A

Démarrage de la gestion

01/02/2009

Fréquence de valorisation

Quotidien

Dépositaire

CM-CIC Securities

Valorisateur

CACEIS Fund Administration

Code ISIN

FR0010250142

Valeur d'une part

8,61 € (31/01/2012)

Actif de la part

25,95 M€ (31/01/2012)

Actif du fonds

26,03 M€ (31/01/2012)

Performances mensuelles du fonds (%)

	Jan	Fév	Mar	Avr	Mai	Jui	Jul	Aou	Sep	Oct	Nov	Dec	Année
2003												0.80 (1)	0.80
2004	0.89	1.57	-3.58	2.41	-1.08	2.38	-1.94	-0.30	1.88	0.58	2.90	2.44	8.23
2005	2.02	4.22	-0.09	-3.36	5.18	3.14	5.27	-1.33	5.71	-4.27	4.07	2.26	24.56
2006	5.59	2.86	3.59	-0.59	-5.13	0.62	0.55	1.64	1.28	1.53	0.26	3.73	16.70
2007	1.95	-2.29	3.23	3.68	3.25	-0.06	-4.01	-1.91	0.61	2.42	-3.84	-1.04	1.58
2008	-11.67	-1.12	-1.78	4.70	1.59	-10.34	-0.46	1.22	-10.39	-16.39	-5.73	0.32	-41.59
2009	-8.50	-12.20	3.84	15.54	3.97	-2.23	10.30	6.00	4.36	-5.78	-1.13	3.05	14.77
2010	-2.87	-3.05	7.87	-1.82	-5.39	-1.67	5.09	-4.27	4.96	2.84	-5.42	5.25	0.28
2011	3.14	1.43	-1.15	2.68	-2.35	-3.12	-6.80	-17.06	-6.42	9.28	-2.44	-1.31	-23.55
2012	3.99												3.99

Avertissement

Ce document est destiné des investisseurs professionnels uniquement et ne peut être distribué en partie ou en totalité à quiconque sans un accord écrit d'Avenir Finance Investment Managers (AFIM). Ce document est incomplet sans les commentaires oraux de votre contact habituel au sein d'AFIM. Il vous est proposé à titre d'information uniquement et ne constitue en aucun cas une sollicitation ou une recommandation, d'achat ou de vente de titres ou de parts de fonds. Les informations contenues dans ce document ne constituent pas un engagement de la part d'AFIM, elles peuvent être amenées à changer sans avertissement préalable autre que ceux prévus par les textes réglementaires en vigueur. AFIM attire l'attention des investisseurs sur le caractère considérablement risqué de la stratégie d'investissement. Toute décision d'investissement ou de désinvestissement prise sur la base de ce document ne saurait engagé la responsabilité d'AFIM. Le fonds peut ne pas être autorisé à la vente dans votre pays et peut ne pas être adapté à votre situation financière et/ou fiscale. Il appartient à chaque investisseur de s'assurer de l'adéquation d'un point de vue juridique, fiscal et financier d'un tel investissement auprès de son conseiller. Les chiffres cités ont trait aux années écoulées et les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures. Le capital investi dans ce fonds n'est pas garanti. Les souscriptions dans le fonds ne sont acceptées que sur la base de leurs prospectus AMF. Le prospectus est disponible sans frais au siège social d'AFIM (cf. contact & Information). AFIM ; Agrément AMF n° GP97124

Contact & Informations

Avenir Finance IM
53 rue La Boétie
75008 Paris - FR
<http://im.avenirfinance.fr>
+33 1 70 08 08 00
contact@avenirfinance.fr