

Juin 2021 : - 0.59% YTD 2021 : + 6.61% Dès lancement : + 48.94% (75 mois)

VNI C USD : 148.94 VNI C CHF : 132.05 VNI C EUR : 136.34 (30 juin 2021)

QUANTIS LOW VOLATILITY est un fonds quantitatif en actions avec une exposition aux grandes sociétés américaines (S&P 500).

L'objectif principal du fonds est de tirer profit de l'anomalie de basse volatilité: un portefeuille d'actions à basse volatilité a délivré un rendement ajusté du risque plus élevé que le marché américain sur les 90 dernières années.

En outre, le processus d'investissement est construit pour minimiser les baisses lors des phases de marchés baissiers.

PROCESSUS D'INVESTISSEMENT

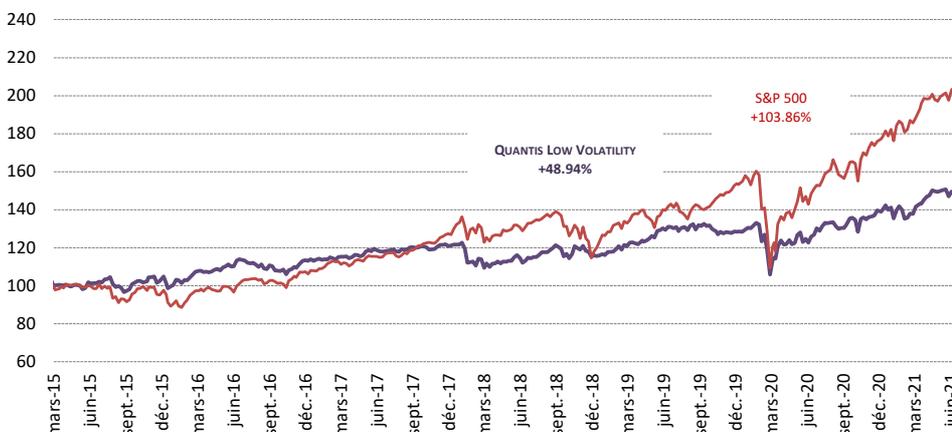
Le processus d'investissement est totalement modélisé et mis en œuvre de façon systématique :

Le fonds détient 40 à 50 actions à basse volatilité (dans l'univers du S&P 500)

- Le portefeuille est reconstitué chaque mois et est couvert avec des contrats futures S&P 500
- La couverture varie entre 30% et 50% en fonction du beta du portefeuille et de la volatilité du marché
- Pour augmenter le rendement, les investissements sont réalisés avec un levier pouvant atteindre 1.3 fois les actifs du fonds

En outre, le fonds utilise 2 techniques pour améliorer le rendement et diminuer les baisses

- Prises de positions sur le VIX en fonction des situations contango/backwardation
- Vente supplémentaire de contrats futures S&P 500 lorsque les marchés sont volatils

PERFORMANCE (RENDEMENT NET POUR LES INVESTISSEURS) (classe C USD)**STATISTIQUES DU FONDS**

	Quantis Low Volatility	S&P 500
Rendement total ⁽¹⁾	48.94%	103.86%
Performance annualisée	6.58%	12.07%
Volatilité ⁽²⁾	9.20%	14.68%
Baisse maximale ⁽³⁾	-19.59%	-30.74%
Ratio de Sharpe ⁽⁴⁾	0.70	0.82

(1) : dès 23/03/2015 (2) : base mensuelle

(3) : base hebdo (4) : taux sans risque = 0.1%

PERFORMANCE MENSUELLES (classe C USD)

	JAN	FEV	MAR	AVR	MAI	JUIN	JUIL	AOÛT	SEP	OCT	NOV	DEC	ANNEE	TOTAL
2021	-3.06%	-0.15%	4.45%	4.48%	1.52%	-0.59%							6.61%	48.94%
2020	1.25%	-5.22%	-7.02%	6.21%	4.06%	-1.29%	4.88%	2.57%	-1.91%	-2.73%	6.12%	2.51%	8.68%	39.71%
2019	0.15%	2.82%	2.05%	0.95%	1.23%	3.12%	-0.44%	2.24%	0.52%	-1.21%	-1.93%	0.28%	10.09%	28.55%
2018	0.38%	-8.36%	0.20%	0.64%	0.08%	-0.34%	2.26%	2.64%	2.35%	-2.71%	3.28%	-3.51%	-3.64%	16.77%
2017	0.88%	0.75%	0.38%	0.80%	1.95%	-0.33%	0.63%	0.35%	0.49%	-0.52%	1.90%	-0.30%	7.18%	21.18%
2016	-1.57%	-0.26%	4.87%	-0.36%	1.91%	0.71%	1.56%	-1.88%	0.25%	-1.52%	0.77%	3.38%	7.91%	13.06%
2015				0.65%	-0.44%	0.95%	2.15%	-3.86%	-2.05%	5.41%	1.93%	0.22%	4.77%	4.77%

GMP - QUANTIS LOW VOLATILITY - INFORMATIONS GÉNÉRALES

Ombrelle	Global Managers Platform (SICAV UCITS V)	Gérant du fonds	Active Niche Funds SA
Domicile	Luxembourg	Conseiller	Quantis Asset Management
Devises	USD / CHF (hedgé) / EUR (hedgé)	ManCo	Casa4Funds
Date de lancement	23 mars 2015	Banque dépositaire	ING Luxembourg
Cut-off	16h00 CET	Administrative & Transfer Agent	CACEIS
Calcul de la VNI	Quotidien	Auditeur	Deloitte
Actifs sous gestion	USD 24.9 M	Frais de souscription	Maximum 3%
Frais à la performance	20% (HWM mensuel + 3% Hurdle Rate)	Frais de vente	Aucun
Classes C Frais de gestion 1.60% Investissement minimum 3'000			
ISIN C USD : LU1196384371 (N° de valeur : 27420459) - ISIN C CHF : LU1196384611 (N° de valeur : 27425280) - ISIN C EUR : LU1439950202 (N° de valeur : 33256519)			
Classes I Frais de gestion 0.95% Investissement minimum 1'000'000			
ISIN I USD : LU1439950384 - ISIN I CHF : LU1439950467 - ISIN I EUR : LU1439950541			

En Suisse, le fonds ne peut être offert ou distribué qu'à des investisseurs qualifiés. Le fonds a nommé un représentant en Suisse: Oligo Swiss Fund Services SA, Av. Villamont 17, 1005 Lausanne, Switzerland, Tel: +41 21 311 17 77, email: info@oligofunds.ch. L'agent payeur du fonds est la Banque Cantonale de Genève. Toute documentation relative au fonds peut être obtenue gratuitement auprès du Représentant en Suisse.

Ce document est fourni à titre d'information uniquement. Ce n'est pas une offre pour vendre une action ou un instrument financier, ni un conseil en investissement. Avant de prendre une décision d'investissement dans ce fonds, il faut se référer à la dernière version du Key Investor Information Document (KIID) (disponible auprès d'ACTIVE NICHE FUNDS). Les investisseurs potentiels doivent prendre les mesures nécessaires afin d'apprécier les aspects légaux, fiscaux et comptables qui s'appliquent à eux en rapport avec un investissement. Les informations contenues dans ce document peuvent changer sans préavis. Les investisseurs doivent s'assurer qu'ils ont la dernière version de ce document. Les données de performance ne tiennent pas compte des éventuels commissions et frais perçus lors d'émission et du rachat de parts. LA performance passée ne constitue pas une indication quant à la performance future. Pour plus d'informations, contactez ACTIVE NICHE FUNDS à l'adresse suivante quantislowvol@activenf.ch. Ce document est publié par le gérant du fonds ACTIVE NICHE FUNDS - Avenue de la Gare 1, CP 5117, 1002 Lausanne, Switzerland, Tel: +41 21 320 11 05

Les performances passées ne donnent aucune garantie quant aux performances futures