

Février 2023 : -3.30% YTD 2023 : -3.66% Dès lancement : +45.30% (95 mois)

VNI C USD : 145.30 VNI C CHF : 123.03 VNI C EUR : 128.47 (28 février 2023)

QUANTIS LOW VOLATILITY est un fonds quantitatif en actions avec une exposition aux grandes sociétés américaines.

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 :

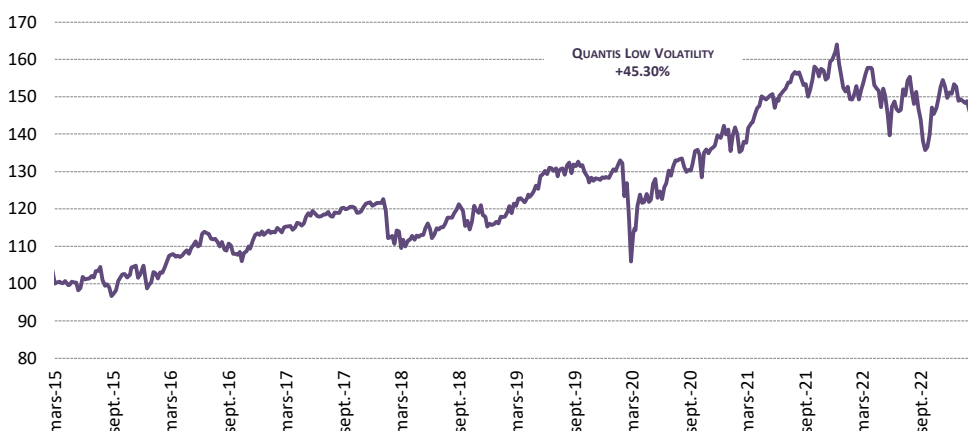
Le fonds détient 40 à 50 actions à basse volatilité (univers des grandes capitalisations américaines)

- 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	
Rendement total <sup>(1)</sup>	45.30%
Performance annualisée	4.83%
Volatilité <sup>(2)</sup>	10.57%
Baisse maximale <sup>(3)</sup>	-19.59%
Ratio de Sharpe <sup>(4)</sup>	0.46

(1) : dès 23/03/2015 (2) : base mensuelle  
(3) : base hebdo (4) : taux sans risque = 0.5%

Catégorie de risque KIID : 5

### PERFORMANCE MENSUELLES (classe C USD)

	JAN	FEV	MAR	AVR	MAI	JUIN	JUIL	AOÛT	SEP	OCT	NOV	DEC	ANNEE	TOTAL
2023	-0.37%	-3.30%											-3.66%	45.30%
2022	-7.08%	-1.86%	3.40%	-0.99%	-1.57%	-2.67%	3.64%	-1.07%	-8.21%	5.92%	5.21%	-1.99%	-8.07%	50.82%
2021	-3.06%	-0.15%	4.45%	4.48%	1.52%	-0.59%	3.24%	1.63%	-4.20%	5.12%	-2.58%	7.01%	17.43%	64.06%
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	Linkfundolutions
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 17.8 M	Frais de souscription	Maximum 3%
Frais à la performance	20% (HWM mensuel + 3% Hurdle Rate)	Frais de vente	Aucun
<b>Classes C</b> 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)			
<b>Classes I</b> Frais de gestion 0.95% Investissement minimum 1'000'000			
ISIN I USD : LU1439950384 - ISIN I CHF : LU1439950467 - ISIN I EUR : LU1439950541			

Émis par Active Niche Funds S.A. (ANF), Avenue de la Gare 1, 1003 Lausanne, Suisse. ANF est agréée et réglementée par la FINMA. Ce document est un support marketing destiné uniquement au «client professionnel». Toute référence à des titres, secteurs ou marchés spécifiques dans le présent document ne constitue pas un conseil en investissement, une recommandation ou une offre d'achat ou de vente de titres ou de fonds, et n'est pas destinée à remplacer les documents d'offre ou le prospectus du Fonds. Ce matériel ne peut être distribué, publié ou reproduit en tout ou en partie. ANF peut mettre fin à la commercialisation à tout moment. Tous les investissements financiers comportent un élément de risque. Par conséquent, la valeur de votre investissement variera et ne peut être garanti. Les données de performance indiquées ne tiennent pas compte des commissions et frais encourus lors de l'émission et du rachat de parts. Les performances passées ne préjugent ni ne garantissent les performances futures. Les investisseurs doivent comprendre toutes les caractéristiques de l'objectif du Fonds avant d'investir. Le Prospectus, les rapports financiers et les Documents d'informations clés qui sont disponibles dans les juridictions enregistrées dans leur langue locale respective, peuvent être consultés sur [www.fundinfo.com](http://www.fundinfo.com). Quantis Low Volatility Fund est domicilié au Luxembourg. Waystone Fund Services (Switzerland) SA, Av. Villamont 17, 1005 Lausanne, Suisse, téléphone: +41213111777. Internet: [www.waystone.com](http://www.waystone.com) est le Représentant suisse du Fonds auprès duquel les documents juridiques sont aussi disponibles. L'Agent payeur suisse du Fonds est la Banque Cantonale de Genève, 17, quai de l'Île, CH-1204 Genève, Suisse. Les cours actuels des actions sont disponibles sur [www.fundinfo.com](http://www.fundinfo.com). Pour plus d'informations sur les droits des investisseurs: [www.activenf.ch/investor-rights](http://www.activenf.ch/investor-rights).