# QUANTIS LOW VOLATILITY

Septembre 2024: -0.36% YTD 2024: +13.74% Dès lancement: +79.30% (114 mois)

VNI C USD: 179.30 VNI C CHF: 142.36 VNI C EUR: 153.68 (30 septembre 2024)

Avenue de Rumine 7, 1005 Lausanne, Switzerland quantislowvol@activenf.ch +41 21 320 11 07

Ce document est un support marketing. Les investisseurs doivent lire les documents PRIIPS KID et prospectus avant d'investir.

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 10% 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)



(3): base hebdo

Quantis Low Volatility										
Rendement total (1)	79.30%									
Performance annualisée	6.34%									
Volatilité (2)	10.50%									
Baisse maximale (3)	-19.59%									
Ratio de Sharpe (4)	0.51									
(1): dès 23/03/2015	(2) : base mensuelle									

(4): taux sans risque = 1.0%

Source : Active Niche Funds

# **PERFORMANCE MENSUELLES (classe C USD)**

	JAN	FEV	MAR	AVR	Mal	JUIN	JUIL	AOÛT	SEP	OCT	NOV	DEC	ANNEE	TOTAL
2024	1.40%	2.32%	3.50%	-3.83%	3.18%	1.52%	3.14%	2.31%	-0.36%				13.74%	79.30%
2023	-0.37%	-3.30%	1.34%	3.40%	-3.63%	4.13%	1.24%	-1.65%	-4.53%	0.13%	7.03%	1.28%	4.52%	57.64%
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%

Source : Active Niche Funds



Avenue de Rumine 7, 1005 Lausanne, Switzerland quantislowvol@activenf.ch +41 21 320 11 06

# **QUANTIS LOW VOLATILITY**

Septembre 2024: -0.36% YTD 2024: +13.74% Dès lancement: +79.30% (114 mois)

VNI C USD: 179.30 VNI C CHF: 142.36 VNI C EUR: 153.68 (30 septembre 2024)

# **GMP - QUANTIS LOW VOLATILITY - INFORMATIONS GÉNÉRALES**

Ombrelle Global Managers Platform (SICAV UCITS V) Gérant du fonds Active Niche Funds

Domicile Luxembourg Conseiller Quantis Asset Management

Devises USD / CHF (hedgé) / EUR (hedgé) ManCo Altum

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 19.0 M
 Frais de souscription
 Maximum 3%

Frais à la performance 20% (HWM mensuel + 3% Hurdle Rate) Frais de vente None

Frais courants (C USD) 2.18% PRIIPS KID 4

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

#### Durabilité

Global Managers Platform – Quantis Low Volatility (Quantis Low Volatility) est classé article 6 au sens de SFDR. Article 6 SFDR: Produit financier ne promouvant pas les caractéristiques ESG ni n'intégrant les risques de durabilité. Pour plus d'informations sur notre politique d'investissement ESG et les informations SFDR: www.activenf.ch

### Information importante

Émis par Active Niche Funds S.A. (ANF), Avenue de Rumine 7, 1005 Lausanne, Suisse. ANF est agréée et réglementée par la FINMA.

Ce document est un support marketing. 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 et/ou la Management Company du fonds peuvent 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 et doivent se référer au prospectus du fonds pour la liste complète des risques ainsi que le PRIIPS KID pour plus d'information sur les coûts.

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 https://manco.altumgroup.com/.

Le fonds Quantis Low Volatility est domicilié au Luxembourg. Waystone Fund Services (Switzerland) SA, Av. Villamont 17, 1005 Lausanne, Suisse, téléphone: +41213111777. Internet: 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'Ile, CH-1204 Genève, Suisse. Les cours actuels des actions sont disponibles sur https://manco.altumgroup.com/. Pour plus d'informations sur les droits des investisseurs: www.activenf.ch/investor-rights