

# Grille d'analyse d'un Fonds

## 1 la performance

- |   |     |     |
|---|-----|-----|
| 1,1 La performance 36 mois est-elle supérieure à celle de son indice ?  | OUI | NON |
| 1,2 Année par année la (sur)performance est-elle régulière ?            | OUI | NON |
| 1,3 La performance est-elle supérieure ou comparable aux autres fonds ? | OUI | NON |

## 2 la volatilité

- |   |     |     |
|---|-----|-----|
| 2,1 La volatilité est elle <b>inférieure</b> à celle de son indice ?          | OUI | NON |
| 2,2 La volatilité est elle <b>inférieure</b> ou comparable aux autres fonds ? | OUI | NON |

## 3 le ratio de Sharpe

- |  |     |     |
|--|-----|-----|
| 3,1 Le ratio de Sharpe est-il positif ?                                  | OUI | NON |
| 3,2 Le ratio de Sharpe est-il supérieur ou comparable aux autres fonds ? | OUI | NON |

## 4 l'Alpha

- |   |     |     |
|---|-----|-----|
| 4,1 L'Alpha est-il positif ?                                  | OUI | NON |
| 4,2 L'Alpha est-il supérieur ou comparable aux autres fonds ? | OUI | NON |

## 5 la Corrélation

- |   |     |     |
|---|-----|-----|
| 5,1 La corrélation est-elle supérieure à 0,9 ou 0,8 ? | OUI | NON |
|---|-----|-----|

## 6 le Béta

- |   |     |     |
|---|-----|-----|
| 6,1 Le Béta correspond-il à votre stratégie ?<br><i>un bêta important implique une amplification des mouvements de l'indice et correspond donc à une stratégie agressive / dynamique.</i> | OUI | NON |
|---|-----|-----|