



Oddo Quant Euro

Fonds actions zone Euro, gestion quantitative active

- Un ratio d'information* élevé et stable : une gestion quantitative qui délivre une surperformance régulière avec une maîtrise constante du risque.
- Un modèle quantitatif exclusif et innovant : un modèle de sélection de titres évolutif qui a fait ses preuves.
- Des sources d'alpha variées et originales : une recherche continue de nouveaux indicateurs pertinents et différenciants.
- Un processus d'investissement pérenne : stabilité et succès du process et de l'équipe de gestion depuis 2002.

POURQUOI INVESTIR DANS CE FONDS ?

Le process de gestion permet de générer de l'alpha quelle que soit la configuration du marché.

Le fonds a un positionnement *core portfolio*, grâce à la régularité et à la solidité de son historique de performance.

Les gérants disposent d'une expertise démontrée par un *track-record* probant.

PHILOSOPHIE D'INVESTISSEMENT

La gestion est active et s'appuie sur un modèle quantitatif interne qui permet de sélectionner les meilleures valeurs de l'univers d'investissement.

Le portefeuille, exposé à 100% au marché actions, est construit sans biais de style sur des paris issus du modèle.

OBJECTIF DE GESTION

Oddo Quant Euro a pour objectif de surperformer de façon régulière son indice de référence (DJ Euro Stoxx Large, dividendes réinvestis) sur un horizon de placement supérieur à 5 ans.

PROCESSUS D'INVESTISSEMENT

1. Univers d'investissement

L'univers d'investissement du fonds est obtenu à partir d'un filtre de liquidité, de capitalisation boursière et de disponibilité des données appliqué aux valeurs de la zone Euro. Le suivi et l'analyse d'un très large univers d'investissement permet de saisir des opportunités hors de cette zone.

2. Modèle quantitatif de sélection de titres

Notre modèle analyse et note chaque titre de l'univers d'investissement à partir de critères d'évaluation, de qualité et de momentum. Les indicateurs d'évaluation sont propres à chaque secteur et le score global de chaque valeur dépend de son exposition au style *growth/value*. Notre modèle cherche à se distinguer des autres modèles quantitatifs classiques en intégrant des critères quantitatifs innovants.

3. Construction du portefeuille

Le portefeuille est construit afin de maximiser l'espérance de sa surperformance par rapport à l'indice pour un risque relatif à l'indice minimal (*tracking error*** inférieure à 4%). Les diversifications sectorielles et géographiques sont proches de celles de l'indice.

4. Contrôle et analyse du portefeuille

Le portefeuille est suivi en continu : actualisation hebdomadaire du modèle quantitatif, analyse de portefeuille, contrôle de risque et suivi des changements de la composition de l'indice.

* Ratio d'information : le ratio d'information est un indicateur de tendance d'un fonds à la sur ou sous-performance de son indice de référence, compte tenu du risque relatif pris par rapport à cet indice. Un ratio d'information positif indique une surperformance, tandis qu'un ratio d'information négatif, une sous-performance. Plus le ratio d'information est élevé, meilleur est le fonds.

** Tracking error : la tracking error est la mesure du risque relatif pris par un fonds par rapport à son indice de référence. Elle est donnée par l'écart type annualisé des performances relatives d'un fonds par rapport à son indice de référence.

Oddo Quant Euro

GÉRANTS

Lan Dang

Responsable de la gestion active quantitative. Ingénieur diplômée de l'Imperial College London, elle a 21 ans d'expérience dans la gestion quantitative.

Élodie Lehmann-Nansot, CFA

Analyste gérant. Diplômée de l'ENSAE et de l'IAF (actuaire), elle cumule 8 ans d'expérience dans la gestion quantitative.

HORIZON D'INVESTISSEMENT

Supérieur à 5 ans.

CARACTÉRISTIQUES

Dénomination	Oddo Quant Euro
Forme juridique	FCP de droit français
Codes ISIN	Part A : FR0000992109 Part B : FR0010230235
Date de création	25/03/2002 (date de changement de l'orientation de gestion)
Société de gestion	Oddo Asset Management
Dépositaire	Oddo Et Cie
Classification AMF	OPCVM « Actions de pays de la zone Euro »
Indice de référence	DJ Euro Stoxx Large (dividendes réinvestis)
Frais de souscription	4% TTC max de l'actif net non acquis à l'OPCVM
Frais de gestion	Part A : 1% TTC max de l'actif net Part B : 0.50% TTC max de l'actif net
Commission de surperformance	-

PROFIL DE RISQUES

Risque de perte en capital, risque lié au type de réplcation utilisé (ce type de gestion peut entraîner une sous performance par rapport à l'indice de référence), risque de taux, risque actions.

Ce document est établi par Oddo Asset Management. Sa remise à tout investisseur relève de la responsabilité de chaque commercialisateur, distributeur ou conseil. Ce document a été réalisé dans un but d'information uniquement et ne constitue ni une offre ni une recommandation personnalisée ou une sollicitation en vue de la souscription de ce produit. L'investisseur est seul juge du caractère approprié des opérations qu'il pourra être amené à conclure. Ainsi, avant toute transaction, l'investisseur doit (i) s'assurer que les supports choisis correspondent à sa situation financière et aux risques auxquels il est prêt à faire face ainsi qu'à ses objectifs d'investissement, (ii) prendre connaissance du prospectus de chaque OPCVM, et comprendre la nature des supports choisis, leurs caractéristiques et leurs risques, notamment de liquidité et de perte en capital. Il est rappelé que les performances passées ne préjugent pas des performances futures. Les informations légales concernant cet OPCVM, notamment les prospectus simplifiés et complets sont disponibles auprès de Oddo Asset Management ou sur le site Internet www.oddoam.fr.

