

Resultaten van de Globes de la Gestion 2015

Het tijdschrift *Gestion de Fortune* heeft op dinsdag 3 november in Parijs de 4^{de} Globes de la Gestion uitgereikt in partnerschap met Quantalys. Er waren 110 personen aanwezig om de 41 fondsen die laureaat waren voor dit klassement, toe te juichen.



Het doel van de selectie: fondsen vinden die er op lange termijn in geslaagd zijn een meerprestatie te realiseren terwijl ze toch weerstand konden bieden aan de sterke dalingen van de markt die zich hebben voorgedaan tijdens de zomer van 2011 en 2015.

De fondsen worden geselecteerd in vergelijking met hun Sortino-index op 5 jaar. Deze is vergelijkbaar met de Sharpe-index, maar neemt het DSR (Down Side Risk) als noemer in plaats van de globale volatiliteit. Het DSR stemt overeen met de volatiliteit, maar enkel wanneer de markt een dalende tendens vertoont (in werkelijkheid onder een bepaalde waarde, in dit geval de Eonia). Met andere woorden, deze bestaat erin te overwegen dat de volatiliteit (de grootte van de schommeling van een waarde rond zijn gemiddelde) enkel een probleem is bij daling.

Bovendien worden, nog steeds met het oog op het in het voetlicht plaatsen van fondsen die weerstand weten te bieden in geval van een krach, enkel die fondsen in overweging genomen waarvan het maximale verschil over de periode van 5 jaar kleiner is dan het gemiddelde maximale verschil van de categorie waartoe ze behoren.

Alle prestaties werden vastgelegd op 30 september 2015.

VERMOGENSFONDS						MAX. VERLIES 5 JAAR: 9,00%		
Nr.	Naam van het fonds	ISIN-code	Valuta	Beheer-vennootschap	Sortino 5 jaar	YTD	5A op jaarbasis	5A totaal
1	SLF (F) Defensive P	FR0010308825	EUR	Swiss Life Asset Managers	2,33	- 1,33%	7,36%	42,64%
2	Nordea 1 – Stable	LU0227384020	EUR	Nordea	1,97	0,78%	6,20%	35,07%

Return Fund

3	Eurose	FR0007051040	EUR	DNCA Investments	1,47	1,36%	5,20%	28,87%
---	------------------------	------------------------------	-----	------------------	------	-------	-------	--------

CONVERTEERBARE OBLIGATIES

MAX. VERLIES 5 JAAR:
14,77%

Nr.	Naam van het fonds	ISIN-code	Valuta	Beheer-vennootschap	Sortino 5 jaar	YTD	5A op jaarbasis	5A totaal
1	DNCA Invest Convertibles	LU0401809073	EUR	DNCA Investments	1,55	2,83%	4,88%	26,89%
2	UBAM Convertibles Euro 10-40	FR0010644674	EUR	UBAM	1,55	1,69%	5,36%	29,86%
3	Oddo Convertibles Taux	FR0000980989	EUR	Oddo Meriten AM	1,47	3,21%	4,82%	26,56%



Met de steun van :

Quantalys