

RIVOLI EQUITY FUND

Reporting mensuel 31-déc.-14

Rivoli Equity Fund a pour objectif de réaliser une performance absolue, c'est-à-dire indépendante de l'évolution des marchés actions, avec des méthodes rigoureuses de contrôle de risque. Le fonds utilise des méthodes de gestion quantitatives qui tirent parti des inefficiences détectées sur les actions Européennes (y compris UK) à l'aide de stratégies de momentum, d'arbitrage statistique et fondamentales.

Chiffres clés

Actif (en millions d'Euros)	19,42
Valeur liquidative	177,23

INDICATEURS DE RISQUE

Volatilité	6,14%
Ratio de Sharpe net	0,77
Drawdown	21,11%

Alpha vs MSCI Europe + UK	0,05%
Beta vs MSCI Europe + UK	0,02

(à partir des vl quotidiennes)

PERFORMANCES

Depuis l'origine	77,23%
Actuariel depuis origine	5,75%
Sur un an	7,15%

Depuis le début de l'année	7,15%
Sur le mois	0,35%

Caractéristiques

Forme juridique	FCP (UCIT)
Devise	Euro
Date de création	06/10/2004
Durée d'investissement recommandée	3 ans
Frais fixes	1,5%
Frais variables	20% au-delà de l'EONIA
Dépositaire	CACEIS Bank
Valorisateur	CACEIS Fastnet
Commissaire aux comptes	PWC

PERFORMANCE DEPUIS LA CREATION



Souscription/Rachat

Code ISIN	FR0010106336
Code Bloomberg	RIVEQFD FP
Liquidité	Quotidienne
Préavis	Aucun
Souscription initiale minimum	1 part

Les ordres peuvent être placés chaque jour ouvré français jusqu'à 12h

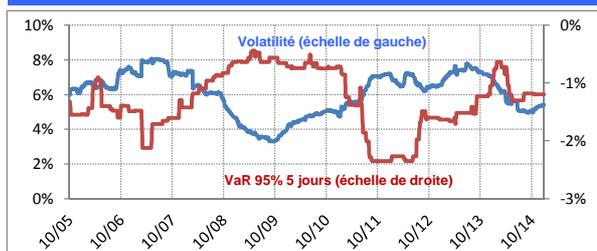
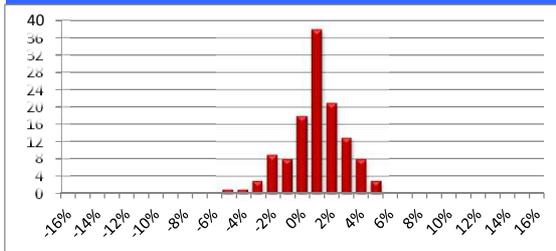
PERFORMANCES MENSUELLES

	Jan.	Fev.	Mars	Avril	Mai	Juin	Juillet	Août	Sept.	Oct.	Nov.	Dec.	Année
2004										0,1%	2,0%	3,7%	5,9%
2005	-0,4%	-0,3%	-1,8%	-2,6%	2,4%	4,9%	0,9%	1,4%	1,9%	-2,5%	1,8%	4,2%	9,9%
2006	1,6%	0,3%	0,9%	-0,6%	-3,9%	-1,1%	-2,2%	2,1%	4,0%	0,3%	0,6%	2,2%	4,0%
2007	0,5%	-3,1%	-0,1%	-2,1%	-0,7%	-0,7%	0,1%	-1,2%	1,5%	3,4%	-0,8%	0,1%	-3,4%
2008	1,8%	0,8%	1,4%	-1,9%	0,3%	3,5%	1,0%	0,3%	0,7%	0,3%	0,3%	0,1%	8,8%
2009	3,0%	1,0%	1,1%	0,6%	-0,2%	-0,8%	0,8%	0,9%	0,4%	0,2%	0,7%	0,2%	8,1%
2010	4,3%	1,5%	2,4%	2,7%	1,0%	-1,4%	-0,5%	1,0%	3,4%	-0,2%	0,3%	1,9%	17,5%
2011	-1,8%	0,0%	2,4%	0,2%	0,3%	-3,4%	-2,5%	-5,4%	-2,2%	0,4%	0,0%	1,1%	-10,7%
2012	-0,9%	0,6%	-2,3%	-4,6%	-1,6%	0,5%	1,4%	0,3%	0,6%	3,5%	0,7%	-2,7%	-4,5%
2013	-0,2%	1,9%	1,9%	2,3%	2,6%	3,5%	2,5%	-0,5%	0,9%	2,5%	-0,3%	1,2%	19,9%
2014	2,2%	0,5%	-1,0%	-3,0%	-0,4%	2,0%	1,1%	-0,7%	2,7%	1,8%	1,7%	0,3%	7,2%

Laurent HIRSCH : 33 1.56.88.24.51

Matthieu BEYLER : 33 1.56.88.24.56

DISTRIBUTION DE LA PERFORMANCE



Les performances passées ne sauraient en aucun cas préjuger des performances futures. Les performances ne sont pas constantes dans le temps.

