



GRANDS PRIX DE LA GESTION D'ACTIFS 2021

Données Méthodologiques

Philosophie

- α est une grandeur absolue qui calcule la surperformance d'un fonds par rapport à un benchmark
Le benchmark utilisé pour un fonds donné est l'indice de catégorie EuroPerformance de la catégorie à laquelle appartient ce fonds.
Les calculs sont réalisés en Euros, après application du taux de change BCE si nécessaire
- Les indices de catégorie EuroPerformance sont des produits dérivés du schéma de classification EuroPerformance, qui est une hiérarchie de classification des fonds.
Ces indices sont calculés en Euros. Les données exprimées dans une autre devise sont converties en utilisant les taux de change de la BCE.
- Les calculs sont réalisés avec le logiciel Engine (SIX).

Données 2020

- Chiffres calculés sur la période du 29/06/2018 au 25/06/2021
- Les fonds analysés doivent répondre aux critères suivants :
 - 3 ans d'existence minimum en valorisation hebdomadaire, bi-hebdomadaire ou quotidienne.
 - La série des rendements hebdomadaires doit être complète (156 points)
En cas de valeur absente un vendredi, nous vérifions si le fonds a été valorisé un des jours précédents, dans une limite de 3 jours pour un fonds à valorisation quotidienne, et de 9 jours pour un fonds à valorisation hebdomadaire ou bi-hebdomadaire. La valorisation la plus récente trouvée dans cette période est utilisée pour reconstituer le rendement manquant. En cas d'échec, le fonds est retiré de la population éligible aux prix.
 - Aucun changement de catégorie en cours de période
 - Actif net de la part supérieur ou égal à 15 millions d'euros
 - Notation EuroPerformance 1111 ou 11111 au 25/06/2021
- Périmètre des fonds étudiés :
 - SICAV et FCP de droit français et de droit étranger commercialisés en France.
 - Fonds maîtres
 - Fonds de fonds
 - Fonds sectoriels
 - La société de gestion ou gestion déléguée doit disposer d'une antenne en France

- Sont exclus :
 - Fonds alternatifs
 - Fonds indiciels
 - Fonds nourriciers
 - Fonds à formule
 - Fonds or et matières premières
 - Fonds immobiliers
 - Fonds de trésorerie
 - Fonds investis sur une zone géographique particulière
 - Fonds obligataires à taux variable (ie indexés sur l'inflation)
 - Fonds obligations convertibles
 - Fonds obligations dont la stratégie est flexible
 - Fonds obligations à échéance
 - Fonds obligations de dettes subordonnées
 - Fonds à engagement (ie fonds à promesse)
 - Gestions « bear » indicielles
 - Fonds à double part
 - Fonds avec une stratégie particulière (ie les fonds 130/30)
 - Fonds couverts contre le risque de change

Les fonds fermés au 25/06/2021 ne sont pas pris en compte dans le palmarès.

Pour les lauréats de chaque prix, SIX vérifie la commercialisation effective des fonds en France sur les trois ans de la période d'étude, ainsi que l'ouverture à la souscription*.

*les fonds semi-fermés ne sont pas retenus dans le cadre de ce prix.

Nous calculons 13 Prix : 7 en catégories Actions, 2 en catégories Diversifiés et 4 en catégories Obligataires :

- Actions USA
- Actions Japon
- Action Asie Hors Japon
- Actions Européennes
- Actions France
- Actions Internationales
- Actions Emergentes
- Diversifiés Europe
- Diversifiés Internationaux
- Obligations Europe
- Obligations émergentes
- Obligations Internationales
- Obligations à Haut Rendement