

Comparatif de performance de 2013 à 2018 arrêté au 31.12.2018

Peer Analysis

Multi-Asset: 25% to 35% Equity Allocation

ISIN	Fund Name	Fund Information			Performance (%)				Performance Rank				3Y Risk		
		Inception Date	Fund Size (mn)	Mstar Rating	YTD	1Y	3Y Ann.	5Y Ann.	YTD	1Y	3Y	5Y	Volatility Ann.	Sharpe Ratio	Max DD
AT0000857164	Fund 1	Nov-86	455	5	-1.05	-1.05	1.57	3.93	Q1	Q1	Q1	Q1	3.45	0.58	-2.95
IT0005117459	Fund 2	Sep-15	620	5	-1.36	-1.36	1.44	-	Q1	Q1	Q1	Q1	2.93	0.64	-3.32
DE0005424576	Fund 3	Jul-02	554	4	-1.40	-1.40	1.16	3.21	Q1	Q1	Q1	Q1	3.27	0.49	-3.45
DE000DWS08Y8	Fund 4	Nov-11	481	4	-3.29	-3.29	-0.04	1.84	Q1	Q1	Q3	Q3	3.01	0.13	-3.91
DE0007019499	Fund 5	Jun-02	860	3	-3.39	-3.39	-0.92	1.29	Q1	Q1	Q4	Q4	2.34	-0.22	-4.34
CPIC part A consolidée					-3.53	-3.53	1.90	3.79	Q1	Q1	Q1	Q1	3.72	0.66	
LU0349157924	Fund 6	Apr-08	1941	3	-3.56	-3.56	-0.57	0.29	Q1	Q1	Q4	Q4	3.36	-0.04	-4.87
DK0060623189	Fund 7	May-15	343	5	-3.57	-3.57	1.24	-	Q1	Q1	Q1	Q1	2.77	-	-3.81
LU0087047162	Fund 8	May-98	636	4	-3.62	-3.62	-0.49	2.20	Q1	Q1	Q3	Q2	2.99	-0.02	-4.34
LU0982876558	Fund 9	Dec-13	450	3	-3.76	-3.76	-0.28	1.26	Q1	Q1	Q3	Q4	2.54	0.06	-4.33
LU0458538880	Fund 10	Mar-10	997	5	-3.81	-3.81	0.79	2.92	Q1	Q1	Q2	Q2	3.10	0.40	-4.29
AT0000990346	Fund 11	Oct-96	853	5	-4.18	-4.18	1.02	2.86	Q1	Q1	Q1	Q2	3.76	0.39	-4.91
DE0009750000	Fund 12	Dec-90	498	4	-4.21	-4.21	0.94	2.35	Q1	Q1	Q1	Q2	3.20	0.43	-5.18
LU0323577766	Fund 13	Oct-07	297	5	-4.22	-4.22	1.93	4.06	Q2	Q2	Q1	Q1	4.20	0.57	-4.75
LU0221793739	Fund 14	Jun-05	932	4	-4.28	-4.28	0.39	3.48	Q2	Q2	Q2	Q1	3.25	0.26	-4.69
IT0003242341	Fund 15	Apr-02	728	3	-4.36	-4.36	-1.35	1.75	Q2	Q2	Q4	Q3	3.32	-0.27	-6.54
BE0947140324	Fund 16	May-07	565	5	-4.57	-4.57	0.29	3.10	Q2	Q2	Q2	Q1	3.30	0.22	-5.42
IT0005238107	Fund 17	Jan-17	961	-	-4.57	-4.57	-	-	Q2	Q2	-	-	-	-	-
ES0138828035	Fund 18	Nov-87	479	3	-4.67	-4.67	-0.11	1.49	Q2	Q2	Q3	Q3	3.35	0.10	-5.62
LU0323577840	Fund 19	Jul-15	1355	5	-4.69	-4.69	1.49	3.73	Q2	Q2	Q1	Q1	3.82	0.51	-5.05
ES0177124031	Fund 20	Nov-06	394	2	-4.78	-4.78	-0.95	0.42	Q2	Q2	Q4	Q4	2.86	-0.18	-5.37
ES0179551231	Fund 21	Jul-93	1156	3	-4.96	-4.96	-0.69	0.73	Q2	Q2	Q4	Q4	2.53	-0.11	-5.38
LU0324635688	Fund 22	Jan-10	365	4	-5.01	-5.01	-0.21	1.72	Q2	Q2	Q3	Q3	3.48	0.07	-5.24
LU1254137224	Fund 23	Oct-15	637	5	-5.07	-5.07	0.08	3.81	Q2	Q2	Q2	Q1	3.60	0.15	-5.96
FR0010308825	Fund 24	Apr-06	331	5	-5.11	-5.11	1.43	2.28	Q2	Q2	Q1	Q2	3.38	0.55	-5.11
IT0000384641	Fund 25	Feb-89	789	4	-5.11	-5.11	0.75	3.07	Q2	Q2	Q2	Q1	3.70	0.33	-5.42
FR0000431116	Fund 26	Oct-97	579	4	-5.14	-5.14	-0.37	1.78	Q3	Q3	Q3	Q3	3.44	0.02	-6.01
LU0139791205	Fund 27	Dec-01	693	4	-5.24	-5.24	0.33	1.61	Q3	Q3	Q2	Q3	3.13	0.25	-5.42
LU0992632454	Fund 28	Dec-13	403	5	-5.29	-5.29	2.32	3.57	Q3	Q3	Q1	Q1	4.51	0.62	-5.40
LU0524307716	Fund 29	Jul-10	3978	4	-5.29	-5.29	-0.10	1.66	Q3	Q3	Q3	Q3	3.35	0.10	-6.14
DE0009782730	Fund 30	Oct-00	461	5	-5.46	-5.46	0.56	1.92	Q3	Q3	Q2	Q2	5.36	0.20	-6.42
IT0000380706	Fund 31	May-85	3398	4	-5.48	-5.48	0.04	2.21	Q3	Q3	Q3	Q2	4.44	0.12	-7.11
LU0566417423	Fund 32	Dec-10	559	2	-5.52	-5.52	-1.40	-0.03	Q3	Q3	Q4	Q4	2.81	-0.35	-6.23
LU0336100762	Fund 33	Jan-08	545	3	-5.56	-5.56	-0.61	0.90	Q3	Q3	Q4	Q4	3.28	-0.05	-6.27
BE0943599804	Fund 34	Nov-05	481	4	-5.62	-5.62	0.36	2.47	Q3	Q3	Q2	Q2	3.70	0.22	-6.35
BE0146661948	Fund 35	Feb-94	381	4	-5.71	-5.71	-0.47	2.40	Q3	Q3	Q3	Q2	3.59	-0.01	-6.39
DE0008476250	Fund 36	May-94	3050	5	-5.73	-5.73	-0.47	3.19	Q3	Q3	Q3	Q1	3.70	0.00	-6.30
LU0284394151	Fund 37	Jun-07	5217	5	-5.74	-5.74	0.87	2.22	Q3	Q3	Q1	Q2	4.46	0.30	-6.63
ES0138709037	Fund 38	Mar-97	415	2	-5.97	-5.97	-1.24	0.10	Q4	Q4	Q4	Q4	3.70	-0.21	-7.12
FR0007051040	Fund 39	Nov-00	4302	4	-6.40	-6.40	0.14	1.49	Q4	Q4	Q2	Q3	4.44	0.14	-7.22
DE000A0KFXJ6	Fund 40	Nov-08	667	4	-6.65	-6.65	-0.65	1.86	Q4	Q4	Q4	Q3	3.38	-0.06	-7.00
FR0010434019	Fund 41	Jan-95	593	3	-6.79	-6.79	-0.20	0.33	Q4	Q4	Q3	Q4	3.15	0.08	-7.49
LU0776414327	Fund 42	Jul-12	376	2	-6.90	-6.90	-0.97	0.10	Q4	Q4	Q4	Q4	3.31	-0.16	-7.89
LU0033040782	Fund 43	Sep-91	1026	3	-6.97	-6.97	0.51	1.33	Q4	Q4	Q2	Q4	3.75	0.26	-7.40
DE000DWSOXF8	Fund 44	Sep-09	937	4	-7.14	-7.14	-0.19	1.69	Q4	Q4	Q3	Q3	3.39	0.08	-7.83
IT0005241085	Fund 45	Mar-17	971	-	-7.55	-7.55	-	-	Q4	Q4	-	-	-	-	-
LU1090960755	Fund 46	Oct-14	330	1	-7.76	-7.76	-1.72	-	Q4	Q4	Q4	-	3.63	-0.35	-8.46
DE000DK2J688	Fund 47	Aug-15	1153	3	-7.92	-7.92	0.28	-	Q4	Q4	Q2	-	4.36	0.18	-8.10
FR0010611293	Fund 48	May-08	1254	4	-9.07	-9.07	0.10	1.39	Q4	Q4	Q2	Q3	4.70	0.13	-9.48
DE0008490673	Fund 49	May-91	477	4	-9.46	-9.46	-1.15	3.35	Q4	Q4	Q4	Q1	8.43	-0.05	-12.98
FR0000980427	Fund 50	Jan-02	710	5	-9.73	-9.73	0.82	3.03	Q4	Q4	Q1	Q2	5.35	0.25	-10.40

Groupe de référence anonymisé constitué des 50 principaux fonds multi-actifs en EUR en termes d'actifs sous gestion, allouant entre 25% et 35% en actions (allocation d'actifs similaire à celle du portefeuille CPIC Part A consolidée). Ce groupe de référence comprend les fonds « accessibles au public » de grandes banques et de compagnies d'assurance.

La performance de ces fonds, comme celle du fonds CPIC est nette de frais de gestion.

La performance de la part A se situe dans le premier quartile pour les trois périodes que nous observons : 1 an, 3 ans et 5 ans.

Sur 3 ans, la part A consolidée présente le meilleur Ratio de Sharpe (unités de performance obtenues en excès du taux sans risque par unité de risque pris).