

Annexe 9 : Ecart-types annualisés

Ecart-types annualisés					
Indices	2012	2013	2014	2015	2016
Euro Stoxx 600 sans exclusion	16,46%	11,92%	12,40%	16,61%	18,68%
Euro Stoxx 600 avec exclusion	16,55%	11,96%	12,44%	16,62%	18,75%
Best-In-Universe (25%)	19,99%	14,18%	14,29%	18,87%	22,05%
Worst-In-Universe (25%)	13,74%	10,84%	12,13%	15,02%	18,12%
Above Median	18,17%	12,89%	13,01%	17,98%	20,10%
Best-In-Universe (75%)	17,52%	12,44%	12,74%	17,32%	19,19%
Best-In-Class (25%)	17,52%	12,81%	12,91%	17,58%	19,33%

Source : réalisation personnelle

Annexe 10 : Ratio de Sharpe

Ratio de Sharpe					
Indices	2012	2013	2014	2015	2016
Euro Stoxx 600 sans exclusion	0,8999	1,7962	0,3061	0,5363	0,1138
Euro Stoxx 600 avec exclusion	0,9034	1,7974	0,3204	0,5456	0,1017
Best-In-Universe (25%)	0,5156	1,2950	0,1903	0,0900	0,0488
Worst-In-Universe (25%)	1,7878	2,9960	0,6925	1,5418	-0,1497
Above Median	0,5107	1,3311	0,0987	0,1161	0,1999
Best-In-Universe (75%)	0,6979	1,4787	0,2037	0,2619	0,1792
Best-In-Class (25%)	0,7019	1,4250	0,3772	0,3685	0,1560

Source : réalisation personnelle