

Modalités de calcul de l'Indicateur Synthétique de Risque et de Rendement (SRRI)

Méthodologie générale :

La méthodologie de calcul de l'indicateur synthétique de risque et de rendement s'appuie sur la volatilité historique de l'OPCVM.

Il s'agit, au moyen des rendements hebdomadaires sur une période de 5 ans, de déterminer la volatilité historique annualisée de l'OPCVM.

Selon la valeur de la volatilité annualisée obtenue, l'OPCVM peut être classé dans l'échelle suivante, structurée en classes de risque :

Classe de risque	Intervalles de Volatilité	
	≥	<
1	0%	0.5%
2	1%	2%
3	2%	5%
4	5%	10%
5	10%	15%
6	15%	25%
7	25%	

La procédure de calcul sur la base de rendements hebdomadaires est la suivante :

1. Mesure des rendements du fonds sur 260 semaines $r_{f,t}$
2. Calcul de la moyenne arithmétique de ces rendements

$$\bar{r}_f = \frac{1}{260} \sum_{t=1}^{260} r_{f,t}$$

3. Calcul de la Volatilité annualisée du fond :

$$\sigma_f = \sqrt{\frac{52}{260-1} \sum_{t=1}^{260} (r_{f,t} - \bar{r}_f)^2}$$

1- TRECENTO ROBOTIQUE ISR

Trecento Robotique ISR est un fonds qui investit en actions de sociétés internationales exposées au secteur de la robotique (notamment les concepteurs/assembleurs de robots et leurs équipementiers fournisseurs de composants, matériel, matière, traitement de données, logiciels ou autres services) et ce sans référence à un indice.

Son objectif est d'offrir :

- Pour la part I EUR : une performance annuelle supérieure à 7 % sur la durée de placement recommandée d'un minimum de cinq (5) ans
- Pour la part R EUR : une performance annuelle supérieure à 6 % sur la durée de placement recommandée d'un minimum de cinq (5) ans
- Pour la part R USD : une performance annuelle supérieure à 6 % sur la durée de placement recommandée d'un minimum de cinq (5) ans

- Si l'historique des rendements sur 5 ans est disponible, la méthodologie qui s'applique est la suivante :
 - Calculer la volatilité du fonds selon la méthodologie générale,

- Si l'historique des rendements est insuffisant (moins de 5 ans), la méthodologie qui s'applique est la suivante :
 - Prendre l'historique des rendements du fonds disponible,
 - Calculer les rendements hebdomadaires de l'indice représentatif (*MSCI World Index*, converti en euros pour les parts I EUR et R EUR et en dollars pour la part R USD)
 - Combiner les deux séries de rendements,
 - Estimer la volatilité annualisée de la série mesurée selon les mêmes étapes que la méthodologie générale,

