



Portrait

Serena System est une méthode de gestion innovante qui se base principalement sur la gestion des risques. L'approche systématique et asymétrique est basée sur des signaux quantitatifs d'achat et de vente. L'univers d'investissement se limite aux titres composant les principaux indices boursiers tels que l'Eurostoxx 50, le SMI, le Dow Jones et le Nikkei. Serena adapte le niveau d'investissement de chaque action au gré des tendances et bénéficie d'une exposition variable « Long/flat ». Le système utilise 3 stratégies équilibrées pour chaque Blue Chip composant l'indice de référence.

Données clés

Equipe : Suisse avec plus de 30 ans d'expérience
Frais de gestion : 1.25% à 0.5% en fonction du montant géré
Frais de performance: Non
Dépositaire : A choix
Liquidité: Hebdomadaire
Véhicules de placement: Mandat dédié et AMC

Objectifs d'investissement *

- Réduction de la volatilité: -45% en moyenne
- Performance à long terme supérieure à l'indice de référence
- Diminution substantielle des drawdowns: -2/3 en moyenne
- Optimisation du ratio rendement/risque

* Voir simulation à long terme en page 2

Commentaire de gestion Serena

SMI: ↘ Investissement de 3% à 45%; ↘ de la volatilité de 20bp à 11.60% | Eurostoxx: ↘ Investissement de 5% à 32%; ↘ de la volatilité de 10bp 12%
 Dow Jones: ↘ Investissement de 4% à 60%; ↗ de la volatilité de 50bp à 13.50% | Nikkei: ↗ Investissement de 1% à 48%; → volatilité stable à 14.50%

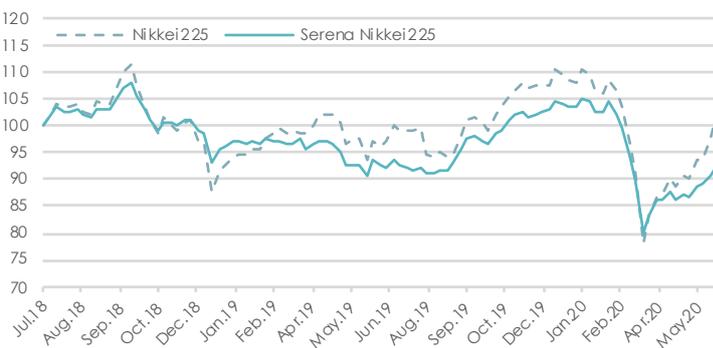
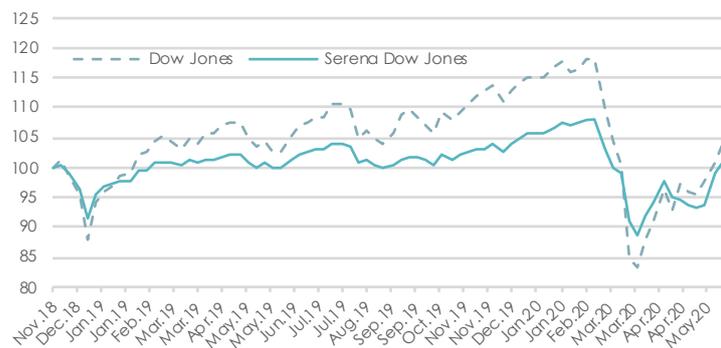
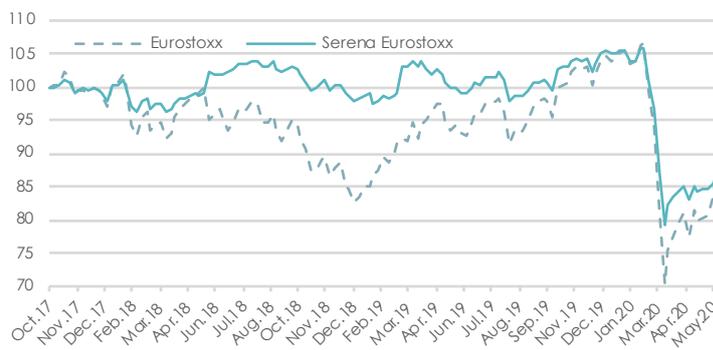
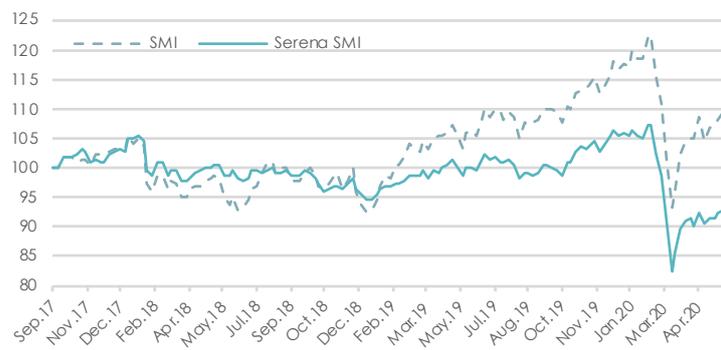
Performances

Résultats

	Début simulation	2018	2019	YTD	Max DD	Vol
Serena SMI	-7.03%	-7.93%	11.30%	-11.92%	-23.11%	11.63%
SMI	9.44%	-10.28%	25.95%	-6.27%	-23.80%	14.75%
	Début simulation	2018	2019	YTD	Max DD	Vol
Serena DJI	0.74%	-8.45%	10.36%	-4.62%	-17.96%	13.51%
DJI	3.88%	-12.29%	22.52%	-9.85%	-29.49%	22.33%

	Début simulation	2018	2019	YTD	Max DD	Vol
Serena SX5E	-12.82%	-0.09%	6.81%	-16.94%	-25.13%	11.99%
SX5E	-12.22%	-14.80%	24.78%	-15.65%	-34.04%	19.40%
	Début simulation	2018	2019	YTD	Max DD	Vol
Serena NI225	-7.31%	-6.68%	8.26%	-10.27%	-25.87%	14.45%
NI225	2.48%	-12.07%	18.20%	-5.63%	-29.91%	43.46%

Evolution comparative





Backtest et simulation

Serena a déterminé des stratégies quantitatives propres à chaque titre, grâce à un back-test effectué sur une période de 20 ans. Depuis mars 2016, date à laquelle les stratégies ont été arrêtées, Serena applique rigoureusement les signaux générés par le système. Vous pouvez constater ci-dessous, que le système SERENA atteint tous ses objectifs sur le long terme.

SMI



Eurostoxx



Dow Jones



Nikkei



Avertissement : Les présentes indications sont fournies à titre commercial et indicatif. Les informations collectées reposent sur des données dignes de confiance et des sources fiables, sans prétendre toutefois à l'exactitude ni à l'exhaustivité des indications relatives aux titres, marchés et évolutions dont il est question. Les informations ci-incluses ne constituent pas une invitation ou une offre à l'achat ou à la vente de titres ou d'instruments financiers apparentés. La performance passée ne saurait préjuger des résultats futurs.