

Cas pratique CGP: comment faire un arbitrage dans QUANTALYS?

Objectifs : créer un Client / créer un ptf transactionnel / faire un arbitrage par l'outil de recommandation de QUANTALYS

Vous travaillez Monsieur Jean VEUPLUS

Vous gérez une assurance-vie pour lui composée ainsi

Fonds	Date	Date d'achat	Valeur €
FR0012333201	Allocation Pilotée Equilibre R(C)	01/01/2020	5460
LU1299303229	Carmignac Pf Emergents A EUR Acc	01/01/2020	3120
FR0013333838	Dorval Gbl Conv Patrimoine R EUR Ac ...	01/01/2020	5460
FR0013345733	Federis ISR France L EUR Acc/Dis	01/01/2020	3900
IE00BZBW4Z27	First Trust US Eq Inc ETF A Dis USD	01/01/2020	10000
QUA000000050	Fonds euro Euro Epargne (0.6%)	01/01/2020	21060
IE0001197916	iShares Europ ex-UK Index (IE) Acc	01/01/2020	9360
IE00BLP58K20	Jupiter Strat Abs Ret Bond L Acc H ...	01/01/2020	4680
FR0007385372	Regard Obligations	01/01/2020	6240

Dans la 1^{ère} hypothèse de travail, vous lui proposez un arbitrage vers un fonds que vous avez identifié.

Vous identifiez en effet un fonds ayant une étoile que vous décidez de remplacer par un fonds de la même catégorie ayant le meilleur sharpe sur 3 ans

Dans la seconde hypothèse, vous laissez à QUANTALYS la responsabilité de désigner le ou les fonds devant servir à l'arbitrage.

EXERCICES

1. Créer la fiche client
2. Créer le portefeuille transactionnel
3. Identifiez le fonds appartenant à la même catégorie et ayant le taux de sharpe sur 3 ans le plus élevé
4. Générer une proposition en désignant le fonds vers lequel arbitrer
5. Générer une proposition en laissant QUANTALYS choisir les fonds vers lesquels arbitrer
6. Comparer les propositions

DOCUMENT RESERVE AUX PROFESSIONNELS

© 2021 Quantalys - Les informations contenues dans ce document appartiennent à Quantalys qui ne garantit ni leur fiabilité, ni leur exhaustivité. Ces informations sont fournies à titre indicatif exclusivement par la société Quantalys. Elles ne constituent pas de la part de Quantalys une offre d'achat, de vente, de souscription ou de services financiers, ni une sollicitation d'une offre d'achat de quelque produit d'investissement que ce soit. Lisez le prospectus du fonds avant toute décision d'investissement. Les performances passées ne préjugent pas des performances futures.