

ECOFI QUANT PERFORMANCE

OPCVM nourricier du FCP Ecofi Quant Force 4

OPCVM diversifié

Décembre 2011



Le portefeuille est exclusivement investi en parts du FCP Ecofi Quant Force 4, lequel vise à obtenir une performance décorrélée des évolutions des marchés financiers et dont la gestion repose sur deux volets : un volet monétaire (géré par Ecofi Investissements) exclusivement investi en valeurs de première catégorie ; un volet quantitatif et systématique (géré par Cogitam, filiale d'Ecofi Investissements) destiné à obtenir un surplus de performance via des interventions sur les principaux marchés à terme.

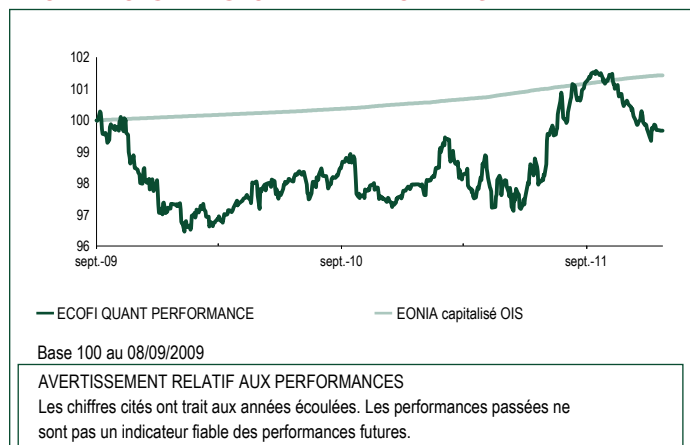
Actif net : 0,53M€
Valeur liquidative au 30/12/2011 (1) : 99,67€
Durée de placement recommandée : 3 ans

(1) La valeur liquidative du 30/12 est estimative et ne peut servir de base à l'exécution d'ordres de souscription et de rachat.



Performance globale
sur 10 ans

INFORMATIONS DE RISQUE ET DE PERFORMANCE



Performances au 30/12/2011

	YTD	1 mois	3 mois	2010	2009	Depuis la création
ECOFI QUANT PERFORMANCE						
Performance flat*	-	-	-	0,65	-	-0,33
EONIA capitalisé OIS						
Performance flat*	-	-	-	0,44	-	1,44
EUROPERFORMANCE**						
Performance catégorie	-	-	-	2,92	7,44	-
Classement	-	-	-	135/204	-	-

*Source Ecofi Investissements **Source Europerformance

Indicateurs de risque

	Fin de mois	31/12/2010
Exposition actions moyenne sur le mois*	0,70	4,34
Sensibilité taux moyenne sur le mois*	0,78	-0,11
Volatilité fonds**	3,54	2,11
Volatilité indice**	0,03	0,02
Ratio de Sharpe**	0,24	0,10
Var 95% - 1 semaine	0,63	1,06

* Source Ecofi Investissements : calculs par transparence - ** Source Europerformance : calcul sur 52 semaines

CARACTERISTIQUES

FCP de Capitalisation

Code ISIN : Part C - FR0010785402

Fréquence de valorisation : Quotidienne

Société de gestion : Ecofi Investissements - SGP agréée par l'AMF n° GP97004

Dépositaire : Crédit Coopératif

Conservateur : Crédit Coopératif (actifs monétaires) Crédit Agricoles Titres (actifs autres que monétaires)

Date de création : 09/09/2009

Classification AMF : OPCVM diversifié

Classification EUROPERFORMANCE : Absolute return

Indice de référence : EONIA capitalisé OIS

Conditions de souscription : chaque jour (J) avant 10h sur la valeur liquidative du jour (J) (cours inconnu) - Règlement J+1

Frais de gestion directs maximum : 0,35% TTC de l'actif net

Frais de gestion indirects maximum : 1 % TTC de l'actif net

Commission de souscription : 1,00 % maximum (non acquis)

Commission de rachat : Néant

Frais de gestion variables indirects : 20 % TTC de l'écart positif de performance entre l'OPCVM et l'indice EONIA.

ECOFI QUANT PERFORMANCE

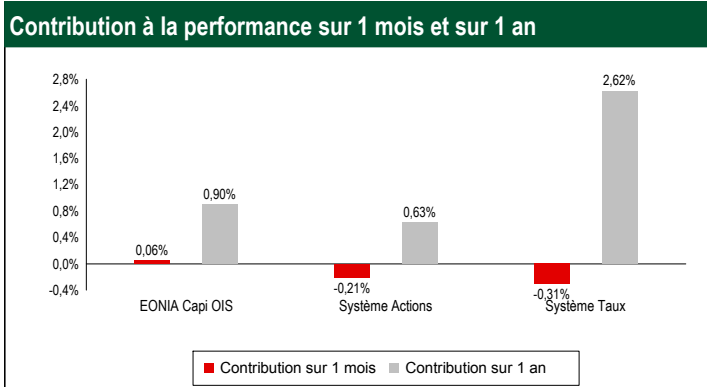
OPCVM nourricier du FCP Ecofi Quant Force 4

OPCVM diversifié

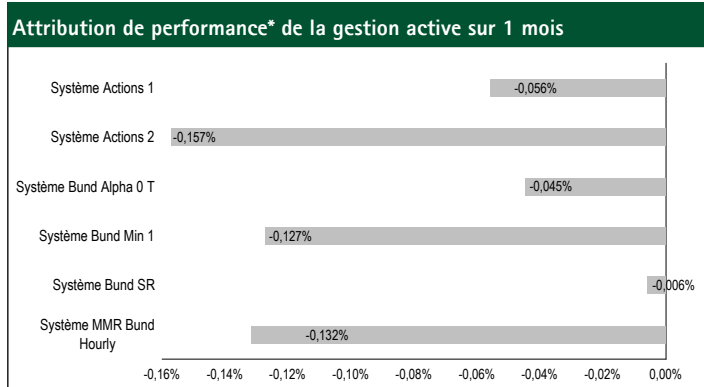
Décembre 2011



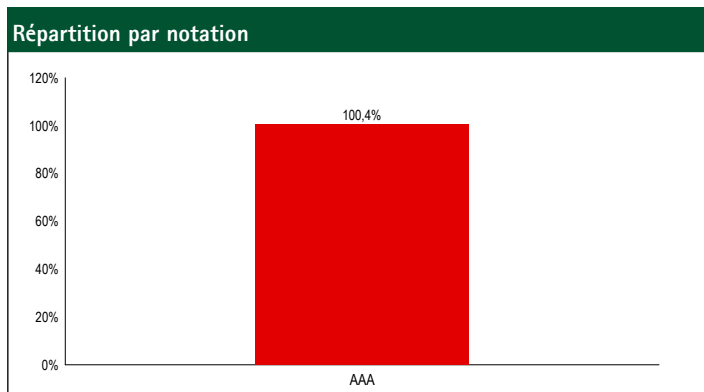
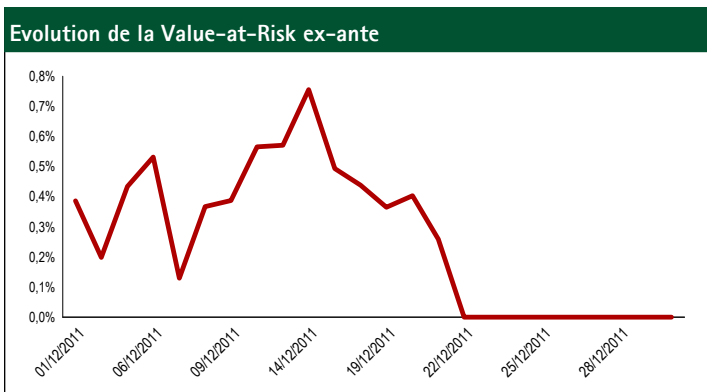
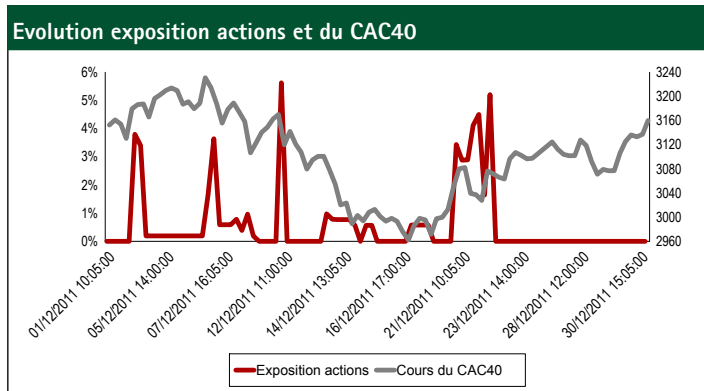
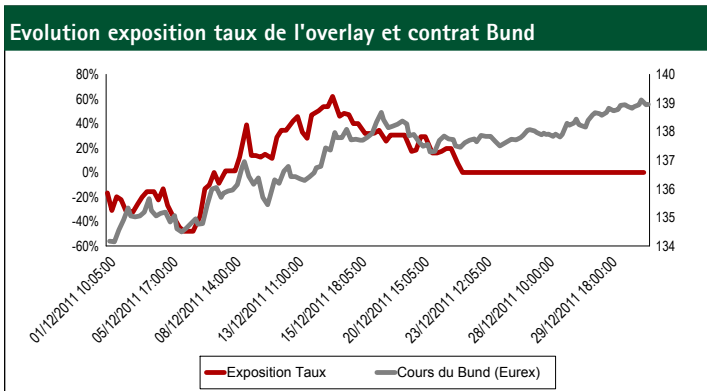
STRUCTURE ET COMPOSITION DU PORTEFEUILLE AU 30/12/2011



* Les performances calculées sont brutes des frais de gestion



* Les performances calculées sont brutes des frais de gestion



Une quote-part des frais de gestion fixes effectivement supportés par le produit est attribuée par Ecofi Investissements au distributeur pour rémunérer l'acte de commercialisation de l'OPCVM. Par ailleurs, les commissions de souscription et de rachat non acquises à l'OPCVM conformément à son prospectus sont intégralement perçues par le distributeur dès lors qu'elles sont prélevées. Le souscripteur de ce fonds sera soumis au risque de taux, de perte en capital, de modèle, risque lié à la surexposition, risque lié aux stratégies d'arbitrage et accessoirement au risque de change. Avant toute souscription, il convient de prendre connaissance du prospectus simplifié de l'OPCVM disponible auprès de la Société de gestion ou sur le site www.ecofi.fr. Le présent document ne constitue pas une recommandation d'investissement personnalisée. Conformément à la réglementation, toute souscription devra être précédée d'une évaluation de l'expérience, de la situation et des objectifs du client à la charge du distributeur.