



FONDS MOMENTUM :

Tirer parti des cycles courts
dans une vision long terme

NOTRE CONVICTION

Les marchés financiers évoluent par cycles rapides, souvent irrationnels, amplifiés par la psychologie collective. Ces dynamiques de court terme génèrent des inefficiences que notre fonds cherche à exploiter activement, tout en conservant une cohérence stratégique à long terme.

INTÉGRATION DANS UNE ALLOCATION GLOBALE

Cœur-satellite :

- Cœur : fonds passifs, allocation stratégique
- Satellite : fonds Momentum pour générer de l'alpha

Apports :

- Complémentarité stylistique (value, low vol...)
- Réduction du risque global par gestion active
- Performance ajustée au risque optimisée

Ballmont BORDEAUX - Place Des Grands Hommes 33000
BORDEAUX

Ballmont PARIS - 11 avenue Delcassé, 75008 PARIS

☎ 05 40 25 60 98
✉ contact@ballmont.fr

STRATÉGIE D'INVESTISSEMENT

Philosophie

Le momentum est un facteur de performance éprouvé : les actifs qui surperforment récemment tendent à continuer leur progression à court terme. Cette stratégie repose sur :

- L'analyse comportementale des marchés (effet de troupeau, sous-réaction)
- Une rotation tactique des actifs sur des cycles courts
- Une gestion active des risques

Approche Multi-signal

Nous combinons des signaux issus de :

- Macroéconomie : politiques monétaires, indicateurs avancés
- Microéconomie : résultats d'entreprises, revalorisations sectorielles
- Géopolitique : tensions, ruptures d'approvisionnement
- Psychologie de marché : stress, flux, asymétries

Portefeuille Dynamique

- Actions à fort momentum
- Obligations court terme pour la stabilité
- Liquidités disponibles pour saisir les opportunités
- Rééquilibrage régulier pour optimiser l'exposition.

PERFORMANCES HISTORIQUES

Année	Fonds Momentum	MSCI World	Sur-performance	Volatilité
2021	+24%	+18%	+6%	16%
2022	-9,5%	-18%	+8,5%	20%
2023	+13%	+11%	+2%	15%
2024	+21,5%	+16%	-5,5%	14%

MÉTHODOLOGIE RIGoureuse

- Score Momentum pondéré par volatilité, liquidité, valorisation
- Entrée sur signal fort, sortie par stop-loss ou inversion détectée
- Rebalancement régulier et contrôle du risque intégré

POURQUOI INVESTIR ?

- Performance prouvée
- Réactivité tactique
- Transparence et reporting régulier
- Diversification intelligente