

AOUT 2020 (données au 31/08/2020)

Dôm Performance Active (DPA) est un fonds spécialisé dans les actions européennes. L'approche d'investissement en 3 parties : **1.** Stock Picking, avec une approche croissance tout en restant attentif et regardant sur le prix, **2.** Fund Picking, avec un modèle de sélection propriétaire basé à la fois sur le quantitatif avec un suivi de plus de 50 ratios ; et une approche qualitative notamment au travers du spectre de la finance comportementale, **3.** Une gestion active de l'exposition via l'utilisation de futures CAC 40

Commentaire de gestion



Valentin BULLE

Au cours du mois d'août, les marchés actions ont évolué dans un canal légèrement haussier et en ont donc profité pour continuer leur progression depuis fin mars.

Ainsi, l' Eurostoxx 50 Net Return réalise une performance de +3.18% sur un mois portant la performance depuis le début de l'année à -11.04%

Au sein de cette hausse de l'indice, de fortes disparités ont été observées au cours du mois.

En effet, les entreprises les plus cycliques et les plus affectées par la crise du coronavirus ont nettement surperformé. Par exemple : Accor +21%, Renault +19%, Arcelor +14%.

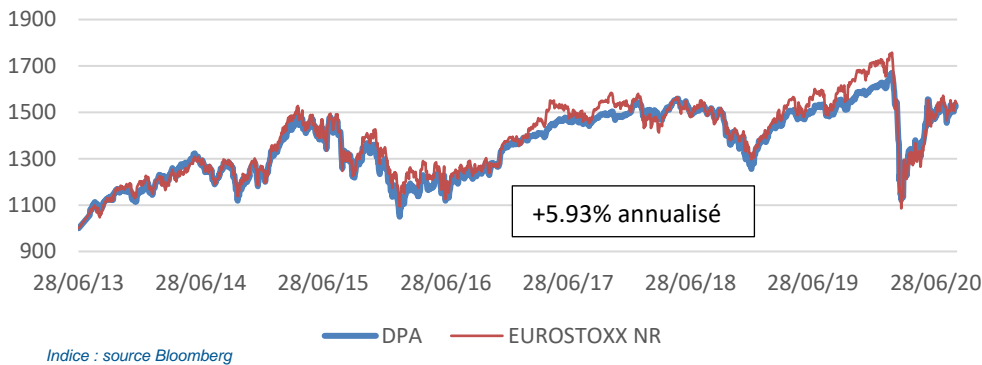
Cette surperformance s'est effectuée au détriment des entreprises défensives telles que : Sanofi -4%, L'Oréal -2%, Air Liquide 0%.

L'exposition reste élevée à plus de 110%.

La performance sur le mois est de +3.90% et de -5.99% sur l'année 2020.

	1 an	3 ans	5 ans
Volatilité du fonds	25.25%	16.14%	15.71%
Volatilité de l'indice	30.82%	20.40%	19.94%
Ratio de Sharpe	0.06	0.09	0.14
β Beta	0,75		
α Alpha	+2.08%	-1.59%	-6.93%
Treynor	0.02	0.01	0.01
Ratio d'information	3.68	0.04	-0.57

A risque plus faible ← A risque plus élevé →



Performances cumulées (%)

	Fonds	Indice
1 mois	+3.90	+3.18
1 ^{er} Janvier	-5.99	-11.04
3 ans	+4.12	+3.08
5 ans	+13.46	+13.94
Création	+51.16	+51.17

Performances Annuelles (%)

	Fonds	Indice
2019	24.16	28.20
2018	-13.52	-12.03
2017	10.84	9.15
2016	5.02	3.72
2015	4.32	6.42

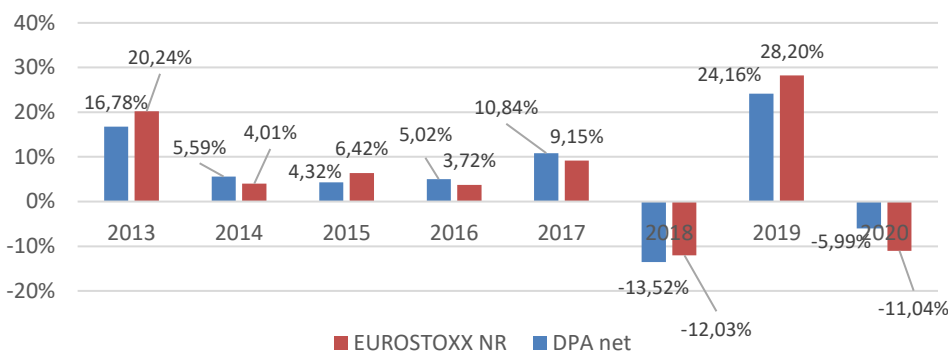
Valeur Liquidative

14.93€

Encours de l'OPCVM

223 M€

Historique des performances annuelles



Principaux mouvements du mois

Achats/Reforcements	Ventes/Allègements
LYXOR SP500 5.9M€	Colville Megatrend 6M€
LYXOR Banks 1.2M€	AXA 1.2M€

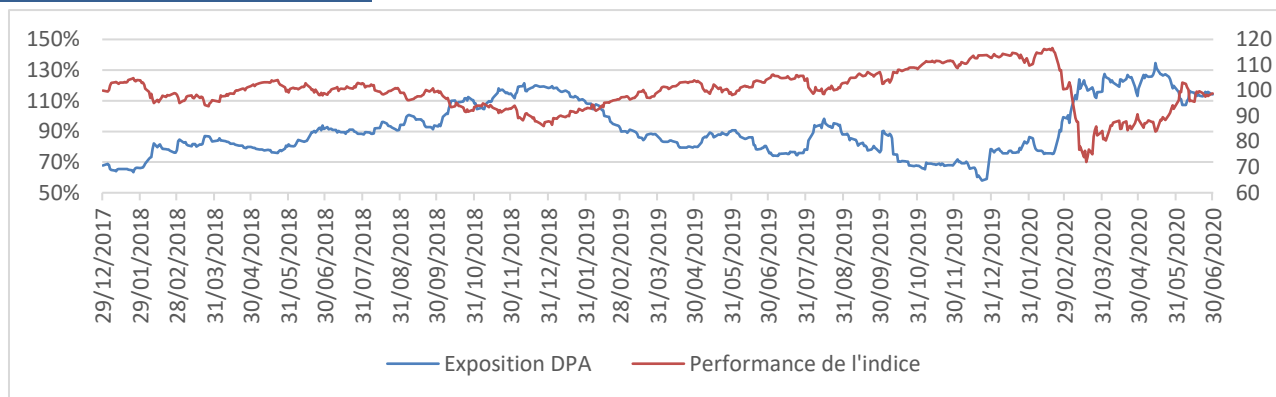
Caractéristiques du fonds

Date de création : 28 juin 2013
Code ISIN : (Part F) LU1909083484
Code ISIN : (Part I) LU1909083567
Code ISIN : (Part R) LU1909083724
Code Bloomberg :
Devise de référence : Euro
Affectation du résultat : Capitalisation pure
Indice de référence : Eurostoxx 50 Div. réinvestis
Durée de placement conseillé : supérieure à 5 ans
Classification : FCP mixte
Eligible au PEA : NON

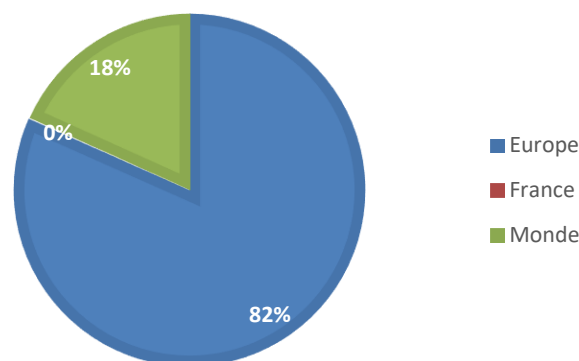
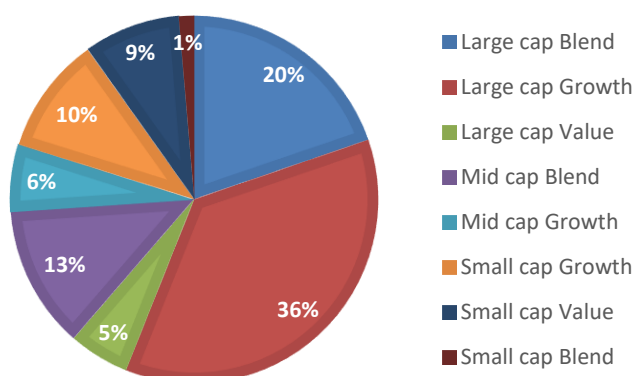
Frais de gestion réels : (Part F) 0.40% TTC max / (Part I) 0.75% TTC max / (Part R) 1.50% TTC max
Commission de souscription : (Part F) Néant / (Part I & R) 5% TTC max
Commission de rachat : (Part F) Néant / (Part I & R) 5% TTC max
Commission de surperformance : (Part F) Néant / (Part I & R) 20% au-delà de l'indicateur
Fréquence de valorisation : Quotidienne
Cut-off : Chaque jour à 15h00, sauf jours fériés
Règlement : J+3
Société de gestion : DÔM FINANCE
n° d'agrément GP04000059
Dépositaire : Banque Degroof Luxembourg
Valorisateur : Banque Degroof Luxembourg

Gestion de l'exposition depuis le 31/12/2017

Exposition en fin de mois : 110.86%



Poche Multigestion



Pondérations

	Valeur	Poche	Poids
1	AXA	Assurance	5.93%
2	SAR	Multigestion	5.18%
3	SARI	Multigestion	5.06%
4	LYXOR Assurance	Assurance	4.79%
5	PREVOIR Gestion Action	Multigestion	3.10%

	Valeur	Poche	Poids
6	RAYMOND JAMES Micro	Multigestion	2.93%
7	TALENCE Euromidcap	Multigestion	2.83%
8	LYXOR SP500	Multigestion	2.63%
9	QUAERO Smaller Comp	Multigestion	2.53%
10	ERASMUS Small Cap	Multigestion	2.45%

Poids des 10 premières positions : 37.43%

Principales variations du mois

Les meilleures performances des lignes directes en €

	Valeur	Variation (€)	Variation
1	LYXOR Assurance	433 800	4.24%
2	TELEVERBIER	264 516	17.50%
3	RENAULT	227 111	18.87%
4	AXA	224 791	1.26%
5	CRCAM IDF	201 149	8.93%

Poids des 5 meilleures performances : 13.26%

Les meilleures performances de la multigestion en €

	Valeur	Variation (€)	Variation
1	PREVOIR Gestion Action	461 175	7.16%
2	SARI	453 845	4.19%
3	Colville Megatrend	441 886	7.48%
4	ERASMUS Small Cap	433 800	6.35%
5	TALENCE Euromidcap	326 112	4.70%

Poids des 5 meilleures performances : 13.44%

Lexique

Volatilité : La dispersion de la performance de la Valeur Liquidative par rapport à la moyenne des performances
Ratio de Sharpe : L'écart de performance de l'OPCVM par rapport au taux sans risque rapportée à la volatilité du fonds.
Alpha de Jensen : Performance de l'OPCVM ajustée du risque pris.
Bêta : La sensibilité de l'OPCVM par rapport au marché, représenté ici par l'indice boursier.
Treynor : Ecart de performance de l'OPCVM par rapport au taux sans risque rapporté au Beta de l'OPCVM
Ratio d'information : le rendement supplémentaire par rapport à un indice divisé par le tracking error.
Tracking error : Elle représente l'écart type de la série des différences entre les rendements du portefeuille et les rendements de l'indice de référence.

Pour plus d'informations

Le fonds est investi sur les marchés financiers. Ce document est remis à titre d'information aux porteurs de parts dans le cadre de la réglementation en vigueur. Les données statistiques reproduites dans ce document sont fournies à titre indicatif et ne sauraient constituer en aucun cas une garantie de performance future des instruments ou valeurs figurant dans ce document. Les informations contenues dans ce document n'ont pas fait l'objet d'un examen ou d'une certification par les commissaires aux comptes de l'OPCVM ou des OPCVM concernés. Les prospectus visés par l'Autorité des Marchés Financiers sont disponibles sur simple demande auprès de DÔM Finance.