

Octobre 2020 (données au 30/10/2020)

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 produits dérivés

## Commentaire de gestion



Valentin BULLE

Au cours du mois d'octobre, les investisseurs internationaux attendaient avec impatience un plan de relance américain de l'ordre de 2 000 milliards de dollars mais les sénateurs démocrates et républicains ne sont pas parvenus à un accord, qui sera certainement le premier dossier de la future administration américaine post élections.

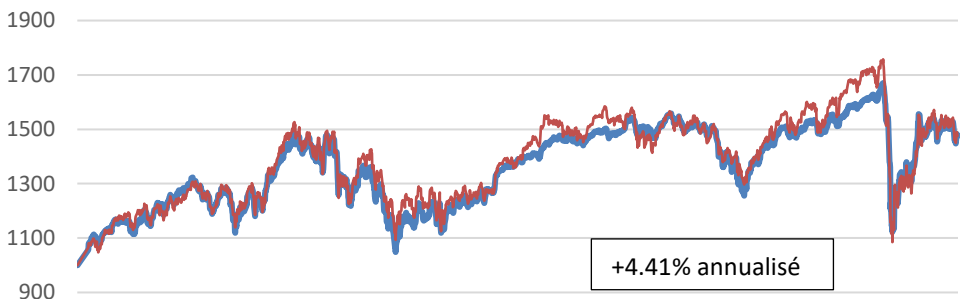
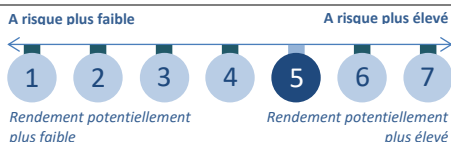
Ajoutez à ce désaccord de mauvaises annonces sur le plan sanitaire avec de nouvelles restrictions de déplacements dans de nombreux pays d'Europe et vous obtenez un mois douloureux pour les marchés actions.

Effectivement, l'Eurostoxx 50 Net Return clôture ce mois avec une performance de -7.31% sans grande tendance sectorielle et malgré des résultats d'entreprises au 3<sup>e</sup> trimestre encourageants dans l'ensemble.

Dans ce contexte, le portefeuille démontre sa résilience dans les baisses en surperformant le marché tout en étant exposé en moyenne à 120%.

La performance mensuelle est de -7.00% portant la performance annuelle à -14.61% contre un indice à -19.46%.

	1 an	3 ans	5 ans
Volatilité du fonds	25.77%	16.68%	15.53%
Volatilité de l'indice	31.03%	20.88%	19.76%
Ratio de Sharpe	-0.49	-0.20	-0.02
β Beta	0,80		
α Alpha	+0.56%	+7.60%	+2.82%
Treynor	-0.16	-0.01	0.00
Ratio d'information	6.56	3.04	1.19



Indice : source Bloomberg

	Performances cumulées (%)		Performances Annuelles (%)	
	Fonds	Indice	Fonds	Indice
1 mois	-7.00	-7.31	2019	24.16
1 <sup>er</sup> Janvier	-14.61	-19.46	2018	-13.52
3 ans	-8.21	-13.22	2017	10.84
5 ans	+2.10	-1.51	2016	5.02
Création	+37.29	+36.86	2015	4.32

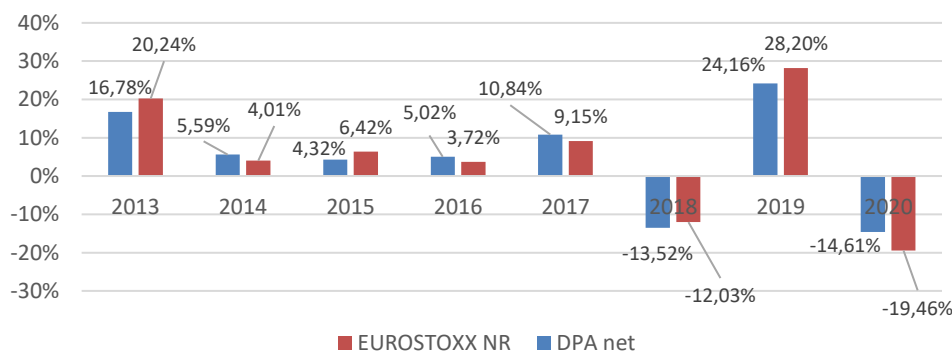
Valeur Liquidative

13.56€

Encours de l'OPCVM

201 M€

### Historique des performances annuelles



### Principaux mouvements du mois

Achats/Reforcements	Ventes/Allègements
CRCAM 300k€	QUAERO Small caps 2.7M€
	LYXOR Asie Pacifique 2.3M€

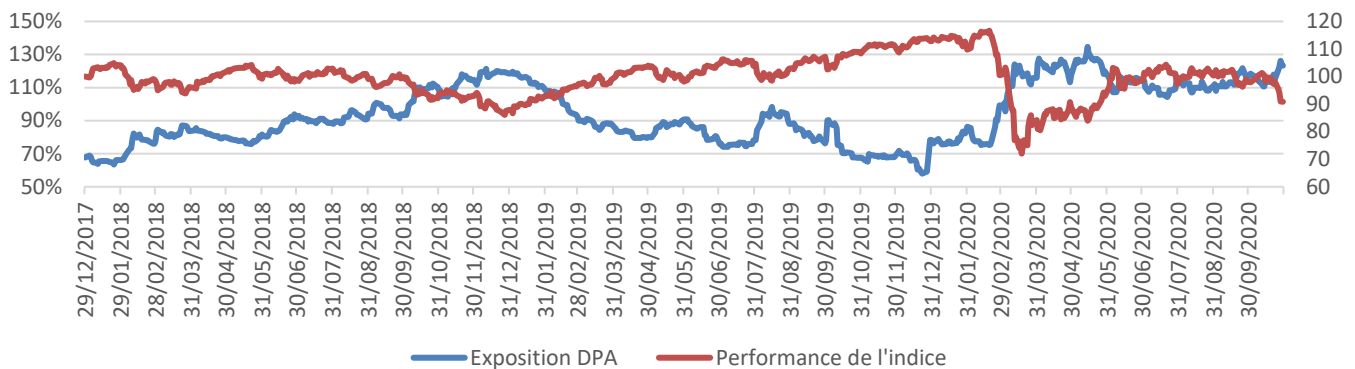
### Caractéristiques du fonds

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

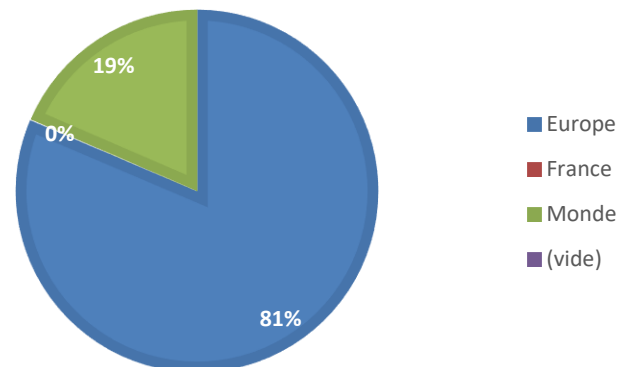
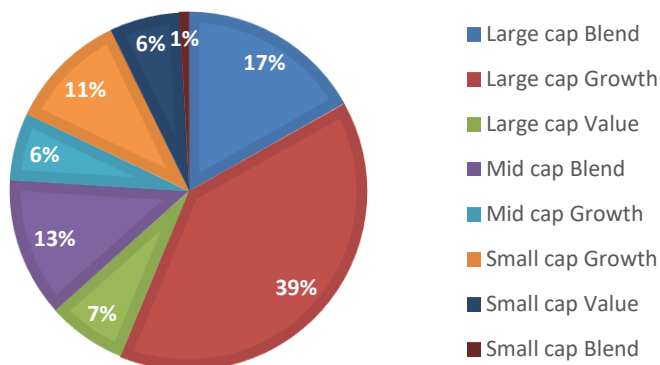
Frais de gestion réels : (Part F) 0.40% TTC max / (Part I) 0.75% TTC max / (Part R) 1.50% TTC max  
Commission de souscription : (Part F) Néant / (Part I & R) 5% TTC max  
Commission de rachat : (Part F) Néant / (Part I & R) 5% TTC max  
Commission de surperformance : (Part F) Néant / (Part I & R) 20%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

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

Exposition en fin de mois : 122%



## Poche Multigestion



## Pondérations

	Valeur	Poche	Poids
1	SAR	Multigestion	5.53%
2	SARI	Multigestion	5.36%
3	AXA	Assurance	5.31%
4	LYXOR Assurance	Assurance	4.61%
5	PREVOIR Gestion Action	Multigestion	3.37%

	Valeur	Poche	Poids
6	RAYMOND JAMES Micro	Multigestion	3.26%
7	TALENCE Euromidcap	Multigestion	2.98%
8	ERASMUS Small Cap	Multigestion	2.64%
9	AMPLEGEST PricingPower	Multigestion	2.46%
10	PHGC European Macro	Multigestion	2.30%

Poids des 10 premières positions : 37.82%

## Principales variations du mois

### Les meilleures performances des lignes directes en €

	Valeur	Variation (€)	Variation
1	EDF	80 473	9.55%
2	UNIBAIL	61 200	7.17%
3	CRCAM LOIRE	50 559	0.15%
4	BANCO SANTANDER	43 035	2.76%
5	HERMES	37 680	8.42%

Poids des 5 meilleures performances : 1.76%

### Les meilleures performances de la multigestion en €

	Valeur	Variation (€)	Variation
1	LYXOR Chine	72 974	3.75%
2	LYXOR Asie Pacifique	66 306	0.13%
3	LYXOR Banks	27 900	-0.36%
4	LYXOR Nasdaq	-1 025	-2.02%
5	AMILTON Premium	-34 949	-4.23%

Poids des 5 meilleures performances : 2.19%

## 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.