

Le fonds Dôm Quantalys 90 a recours à la multigestion. Le profil 90 est un profil dynamique. Approche qui consiste à rechercher les OPCVM qui montrent leur capacité à générer une surperformance récurrente, par rapport à leurs pairs. La sélection des fonds se fonde sur une analyse statistique comparative fournis par Quantalys France.

Commentaire de gestion



Grégory Olszowy
Gérant

Les marchés d'actions et d'obligations ont connu en mars une séquence de forte baisse et de volatilité élevée, à la suite du déclenchement le 28 février d'un conflit armé majeur au Moyen-Orient, opposant les USA alliés à Israël à l'Iran. Dès lors, ils ont évolué principalement en fonction des anticipations des investisseurs quant à la durée du conflit et à son impact potentiel sur l'économie mondiale avec comme baromètre les variations des cours du pétrole lesquels ont inévitablement flambé, passant dès la première semaine de 70\$ à 100\$ puis montant jusqu'à 120\$.

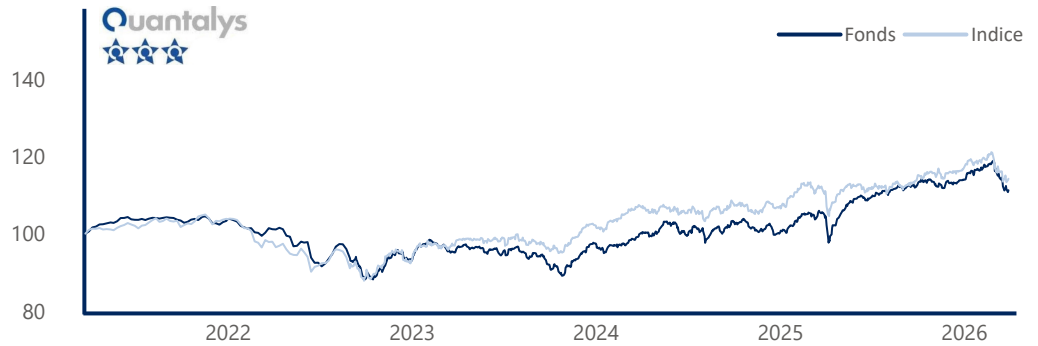
En effet, confronté à la supériorité militaire de la coalition, l'Iran a mis en place une stratégie d'embrassement de la région par des attaques contre l'ensemble des pays du Golfe et de maximisation du coût économique du conflit par des attaques contre des installations pétrolières et gazières et par le blocage de fait du détroit d'Ormuz par lequel transitent notamment 20% de la consommation mondiale de pétrole et de gaz liquéfié.

Déséquilibre structurel entre l'offre et la demande d'hydrocarbures et donc envolée des prix, hausse du prix de fret maritime, hausse de l'incertitude géopolitique, dégradation des conditions financières par la hausse des taux, baisse du pouvoir d'achat et donc de la consommation, c'est un véritable choc stagflationniste qui menace désormais les économies et les marchés.

Et cette menace, qui remet en cause le scénario de politique monétaire accommodante précipite en même temps à la baisse actions, obligations (en particulier dans la partie courte de la courbe) et métaux précieux. Ainsi, l'Eurostoxx50 perd sur le mois plus de 9%, les marchés de dette 3% avec un rendement du bund 10 ans qui se tend de 40 bps tandis que celui du 2 ans grimpe de 60 bps, l'or plus de 12%.

Le fonds varie de -6,24% sur le mois de mars, portant la performance depuis le début de l'année à -2,42%. La volatilité se situe à 7,12%.

Evolution du fonds sur 5 ans (Base 100)



Performances cumulées

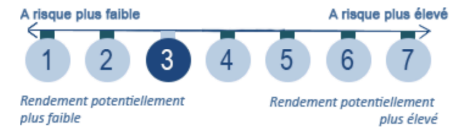
Nom	Fonds	Indice
1 mois	-6,24 %	-5,51 %
1er janvier	-2,42 %	-2,09 %
1 an	6,10 %	3,59 %
3 ans	15,86 %	16,21 %
5 ans	11,21 %	14,18 %
Création	-18,56 %	48,05 %

Indicateurs de risque

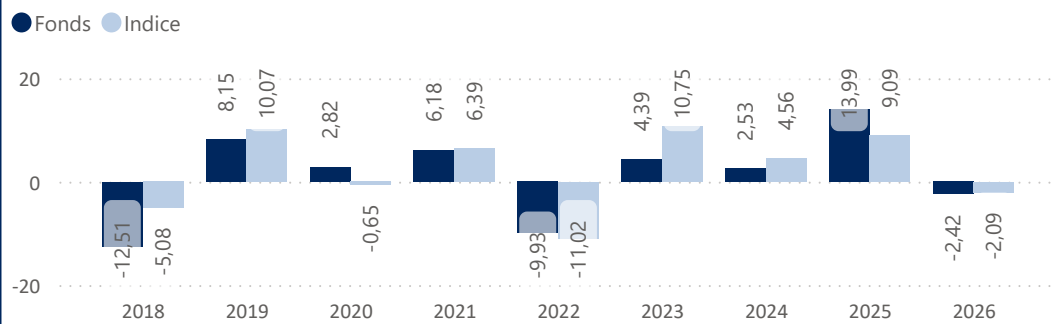
Nom	1 an	3 ans	5 ans
Volatilité fonds	7,12%	6,24%	6,51%
Ratio de Sharpe	0,43	0,32	-0,13
Ratio d'information	3,45	-0,16	-0,55

Performances annualisées

3 ans	5,03 %	5,13 %
5 ans	2,15 %	2,69 %
Création	-1,04 %	2,02 %



Historique des performances annuelles (%)



Valeur Liquidative

81,44 €

Encours de l'OPCVM

3 503 155 €

Caractéristiques du fonds

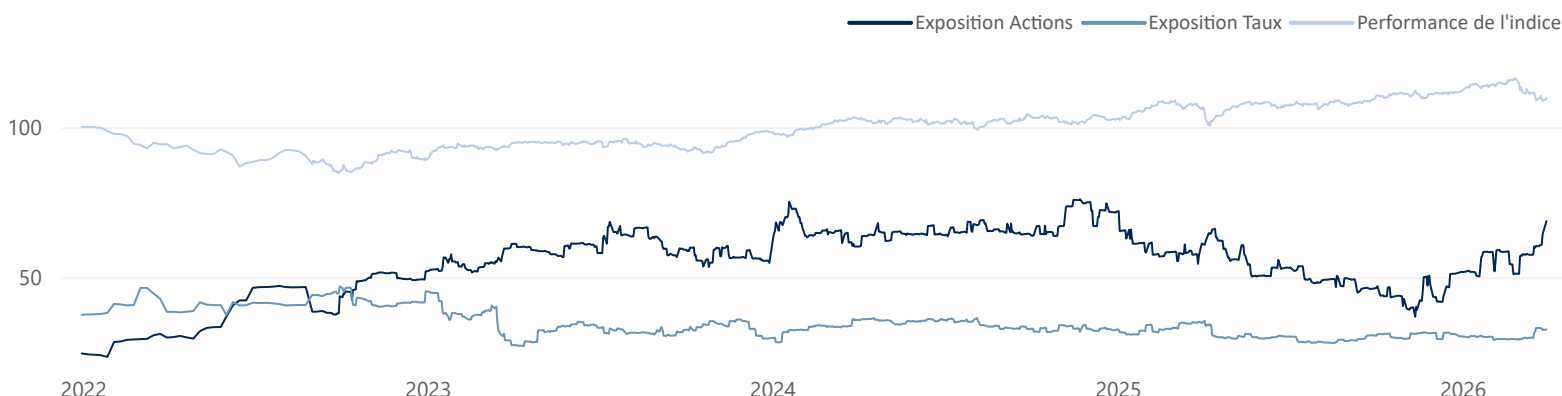
Date de création : 10 août 2006
Code ISIN : FR0010313718
Indice de référence : 20% ESTER, 35% Euro MTS 5-7, 45% Eurostoxx 50 dividendes nets réinvestis
Devise de référence : Euro
Affectation du résultat : Capitalisation
Classification : FCP mixte
Durée de placement conseillée : 5 ans
Eligible au PEA : NON
SFDR : Article 6

Commission de gestion : 2,10% TTC max
Commission de souscription : 2,50% TTC max
Commission de rachat : 2,50% TTC max

Commission de surperformance : Néant
Fréquence de valorisation : Quotidienne
Cut-off : Chaque jour à 15h00, sauf jours fériés
Règlement : J+3
Dépositaire : SGSA
Valorisateur : SGSS

Gestion de l'exposition depuis le 31/12/2021

Exposition actions / taux en fin de mois : 68,71% / 32,62%



Principaux mouvements du mois

Achats / Renforcements

FUT EUROSTOXX VGM6 Jun26
Placeuro Gold Mines - PARTS C - Capi

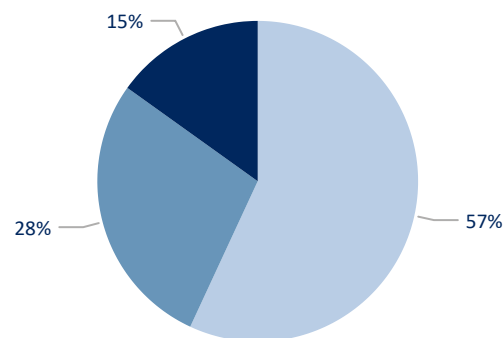
Ventes / Allègements

FUT EUROSTOXX VGH6 Mar26
FUT EUROSTOXX VGM6 Jun26

Pondérations

	Valeur	Poche	Poids
1	DOM Finance - DOM Patrimoine-Part I	Multigestion	17,23 %
2	DOM SELECTION ACTION MIDCAP	Multigestion	11,46 %
3	DOM PATRIMOINE - Part R	Multigestion	6,84 %
4	FUT EUROSTOXX VGM6 Jun26	Future action	6,23 %
5	DOM Alpha Obligation Credit-Part C	Multigestion	6,03 %
6	DOM CAPI	Multigestion	5,65 %
7	BDL Convictions 4D	Multigestion	5,01 %
8	Indépendance ET expansion - Europe	Multigestion	4,01 %
9	DOM Selection Action Rendement-Part C	Multigestion	3,89 %
10	Banque St-Olive BSO Bio Sante	Multigestion	3,71 %

● Fonds actions ● Fonds mixtes ● Fonds obligataires



Poids des 10 premières positions : 70,06%

Les meilleures performances en €

	Valeur	Variation (€)	Variation
1	DOM Orchidee I Long/Short	-207,05	-0,01 %
2	Aberdeen -China A Share Equit...	-587,25	-0,02 %
3	Lazard Convertible Global-Part R	-1 414,70	-0,04 %
4	Indépendance Europe Mid - Par...	-1 470,15	-0,04 %
5	DOM Selection Action Rendem...	-2 536,13	-0,07 %

Les moins bonnes performances en €

	Valeur	Variation (€)	Variation
1	DOM SELECTION ACTION MIDC...	-31 706,48	-0,85 %
2	BDL Convictions 4D	-21 483,60	-0,58 %
3	DOM Finance - DOM Patrimoin...	-19 270,58	-0,52 %
4	Immobilier 21-Part AC	-17 449,92	-0,47 %
5	DOM Selection Action Rendem...	-16 532,19	-0,44 %

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.