

août 2024 (données au 30/08/2024)

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

Le mois d'août 2024 n'a pas dérogé à la règle qui veut que souvent, au creux de la période estivale, advienne un épisode de volatilité. Commencé par l'annonce par la Banque du Japon d'un relèvement de ses taux directeurs entraînant une forte appréciation du yen et réduisant d'autant la profitabilité des opérations de carry trade, cet épisode s'est renforcé par les chiffres du marché du travail aux USA qui faisaient état d'un net ralentissement du rythme de création d'emplois (114k seulement en juillet contre 206k en juin) et laissaient craindre que la politique monétaire restrictive ne fasse dérailler l'activité économique.

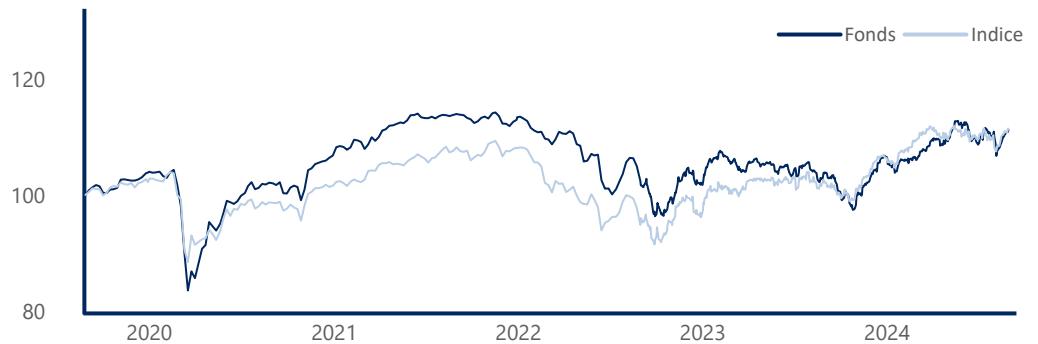
En fin de mois, J Powell, au symposium de Jackson Hole, faisait enfin l'annonce tant attendue par les marchés, celle que le temps était venu de faire varier la politique monétaire et donc baisser les taux, afin notamment de favoriser le marché de l'emploi.

Episode intense, -7% en moyenne pour les grands indices mondiaux d'actions en seulement 3 séances, mais de courte durée puisque les indices se ressaisissaient rapidement, favorisés par la nette détente sur les taux d'intérêt (baisse de près de 20bps du bund 10 ans), puis par des statistiques américaines qui attestaient notamment d'un rebond de la consommation.

Au total, les marchés d'actions surmontaient leur baisse initiale pour terminer le mois en hausse (+ 1.75% pour l'Eurostoxx50) tandis que le bilan sur les marchés obligataires était quasi neutre. A noter également la nette appréciation de l'euro face au dollar de 1.08 à 1.11.

Le fonds varie de 0,68% sur le mois d'août, portant la performance depuis le début de l'année à 4,31%. La volatilité se situe à 6,31%.

Evolution du fonds sur 5 ans (Base 100)



Performances cumulées

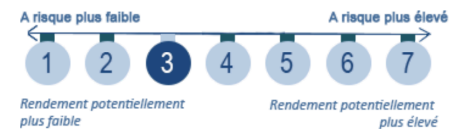
Nom	Fonds	Indice
1 mois	0,68 %	0,97 %
1er janvier	4,31 %	4,58 %
1 an	7,24 %	8,68 %
3 ans	-2,26 %	3,52 %
5 ans	11,20 %	11,35 %
Création	-25,51 %	38,64 %

Indicateurs de risque

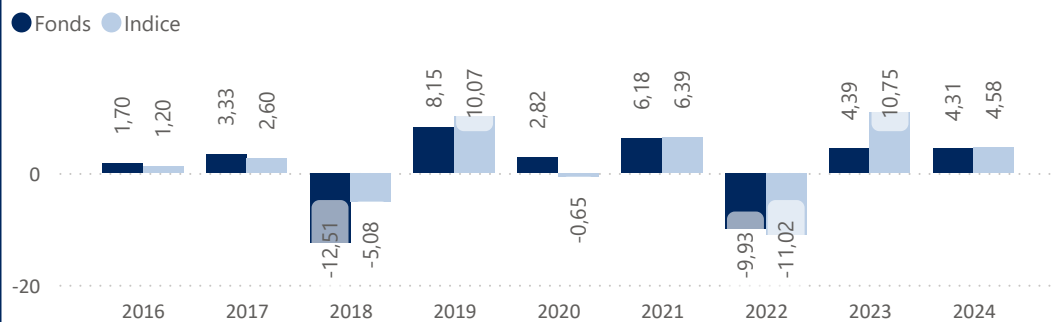
Nom	1 an	3 ans	5 ans
Volatilité fonds	6,31%	6,87%	9,06%
Ratio de Sharpe	0,78	-0,45	-0,02
Ratio d'information	-2,74	-1,68	-0,02

Performances annualisées

3 ans	-0,76 %	1,16 %
5 ans	2,15 %	2,17 %
Création	-1,62 %	1,82 %



Historique des performances annuelles (%)



Valeur Liquidative 74,49 €

Encours de l'OPCVM 3 296 358 €

Caractéristiques du fonds

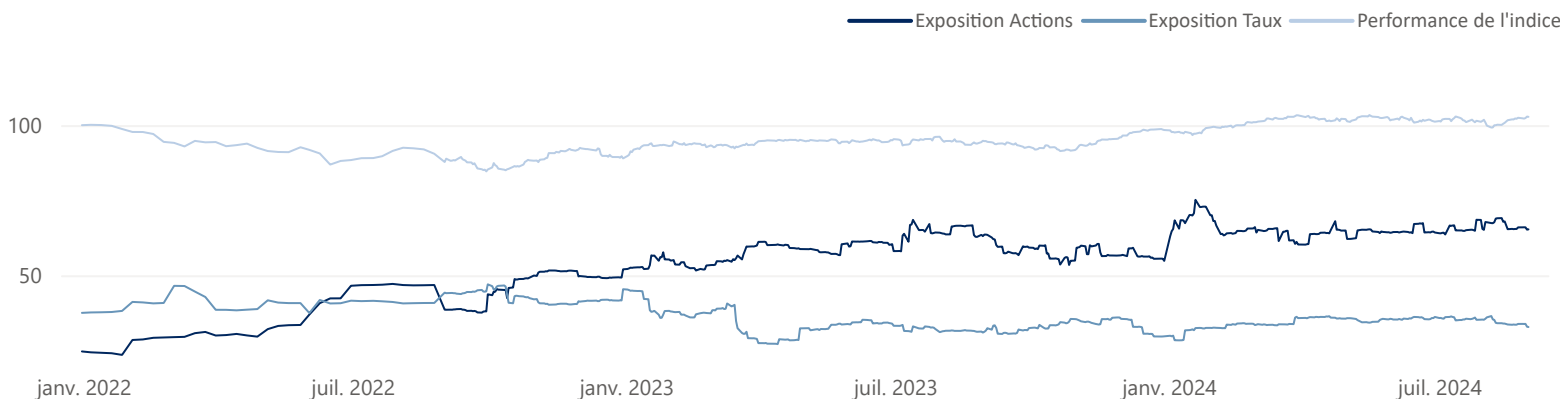
Date de création : 10 août 2006
Code ISIN : FR0010313718
Indice de référence : 20% ESTER, 35% Euro MTS 5-7, 45% Eurostoxx 50 dividendes nets réinvestis
Devise de référence : Euro
Affectation du résultat : Capitalisation
Classification : FCP mixte
Durée de placement conseillée : 5 ans
Eligible au PEA : 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 : 65,29% / 32,77%



Principaux mouvements du mois

Achats / Renforcements

FUT EUROSTOXX Sept24 VGU4

Ventes / Allègements

DOM Alpha Obligation Credit-Part C

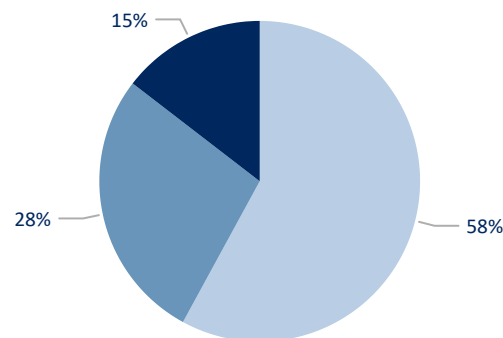
DOM Finance - DOM Patrimoine-Part I

FUT EUROSTOXX Sept24 VGU4

Pondérations

	Valeur	Poche	Poids
1	DOM Finance - DOM Patrimoine-Part I	Multigestion	17,50 %
2	DOM SELECTION ACTION MIDCAP	Multigestion	11,23 %
3	DOM PATRIMOINE - Part R	Multigestion	6,99 %
4	BDL Convictions 4D	Multigestion	6,03 %
5	DOM CAPI	Multigestion	5,96 %
6	DOM Alpha Obligation Credit-Part C	Multigestion	5,80 %
7	DOM Selection Action Rendement-Part C	Multigestion	5,73 %
8	Placeuro Gold Mines - PARTS C - Capi	Multigestion	5,59 %
9	Independance ET expansion - Europe	Multigestion	4,55 %
10	Moneta Multi Caps	Multigestion	3,34 %

● Fonds actions ● Fonds mixtes ● Fonds obligataires



Poids des 10 premières positions : 72,73%

Les meilleures performances en €

	Valeur	Variation (€)	Variation
1	Immobilier 21-Part AC	5 714,55	0,17 %
2	BDL Convictions 4D	4 571,84	0,14 %
3	DOM SELECTION ACTION MIDC...	3 301,20	0,10 %
4	BNY Mellon Global Funds -Glob...	3 128,39	0,10 %
5	DOM Selection Action Rendem...	2 427,67	0,07 %

Les moins bonnes performances en €

	Valeur	Variation (€)	Variation
1	Quadrige Rendement France M...	-2 232,24	-0,07 %
2	Independance ET expansion - E...	-1 869,60	-0,06 %
3	Aberdeen -China A Share Equit...	-1 383,23	-0,04 %
4	Regnan Sustainable Water & W...	-985,20	-0,03 %
5	Moneta Multi Caps	-707,35	-0,02 %

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.