

décembre 2024 (données au 31/12/2024)

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

“ Au terme d'un mois marqué par une assez forte volatilité, les marchés actions et obligations ont connu des sorts opposés, les marchés actions réussissant à conserver une partie de leurs gains initiaux tandis que les marchés obligataires subissaient une dégradation ininterrompue.

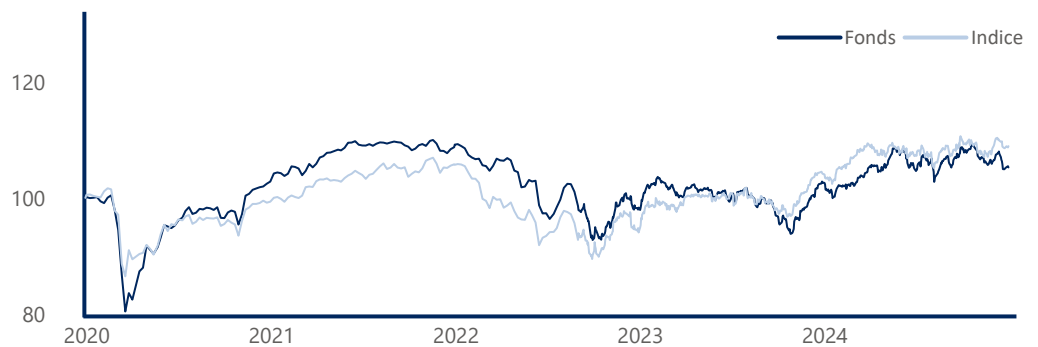
Le mois avait débuté sur une note presque euphorique pour les actions à la faveur de nouveaux records sur les places américaines et d'annonces par les autorités chinoises de plan de relance monétaire et budgétaire. Mais, l'absence d'éléments concrets concernant ces plans, l'incertitude entourant la politique commerciale de la future administration américaine et surtout le discours réservé des dirigeants des banques centrales renversaient la dynamique initiale.

Dans un contexte de rebond de l'inflation aux USA, où elle s'avère particulièrement tenace (+3.3% pour le CPI core), mais aussi en Europe, la BCE comme la FED ont certes abaissé une nouvelle fois les taux directeurs, mais ont prévenu d'une politique à venir plus restrictive qu'anticipé. Les taux se tendaient fortement aux USA avec un 10 ans à 4.60% contre 4.15% et en Europe 2.40% contre 2.10% pour le 10 ans allemand.

A noter enfin la nette sous performance des actifs français qui perdent en quelques mois la prime que leur valaient des décennies de stabilité des institutions.

Le fonds varie de -0,85% sur le mois de décembre, portant la performance depuis le début de l'année à 2,53%. La volatilité se situe à 5,96%.

Evolution du fonds sur 5 ans (Base 100)



Performances cumulées

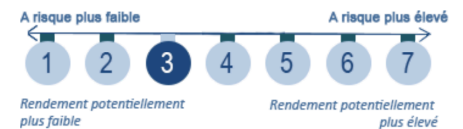
Nom	Fonds	Indice
1 mois	-0,85 %	0,39 %
1er janvier	2,53 %	4,56 %
1 an	2,53 %	4,56 %
3 ans	-3,59 %	3,03 %
5 ans	5,25 %	8,91 %
Création	-26,78 %	38,61 %

Indicateurs de risque

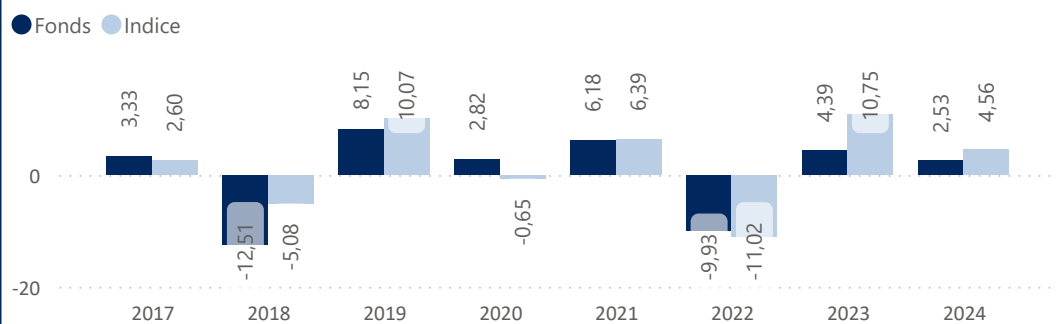
Nom	1 an	3 ans	5 ans
Volatilité fonds	5,96%	7,01%	9,12%
Ratio de Sharpe	0,03	-0,51	-0,15
Ratio d'information	-3,60	-2,03	-0,60

Performances annualisées

3 ans	-1,21 %	1,00 %
5 ans	1,03 %	1,72 %
Création	-1,68 %	1,79 %



Historique des performances annuelles (%)



Valeur Liquidative

73,22 €

Encours de l'OPCVM

3 225 121 €

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

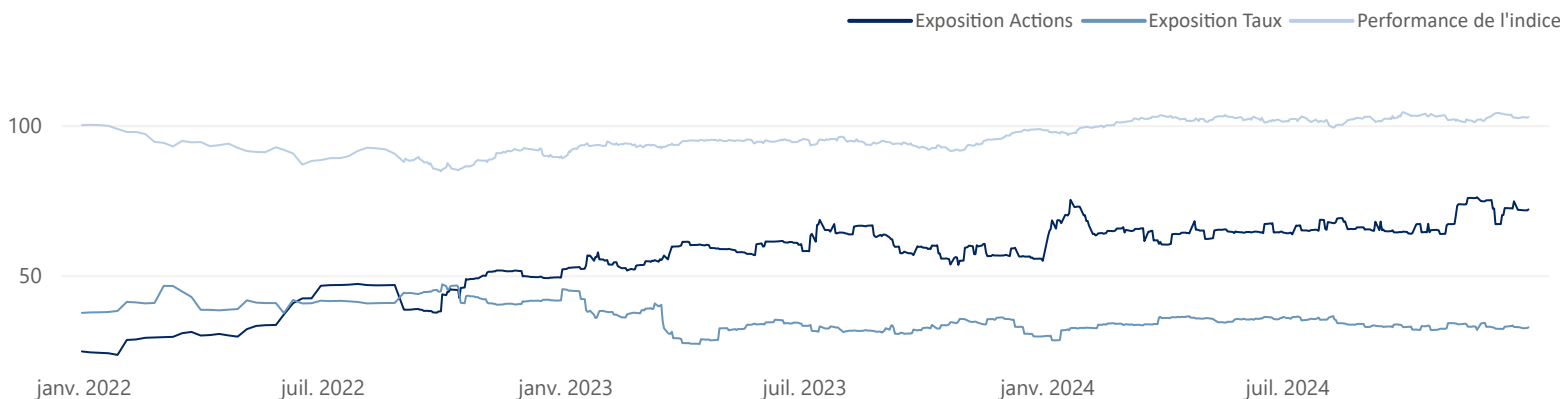
Règlement : J+3

Dépositaire : SGSA

Valorisateur : SGSS

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

Exposition actions / taux en fin de mois : 71,93% / 32,67%



Principaux mouvements du mois

Achats / Renforcements

BDL Transition-Part GP
FUT EUROSTOXX VGH5 Mar25
Indépendance ET expansion - Europe

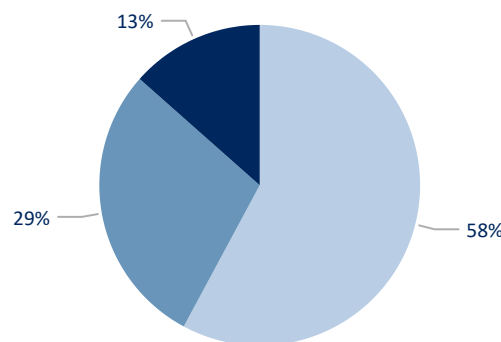
Ventes / Allègements

FUT EUROSTOXX Dec24 VGZ4
FUT EUROSTOXX VGH5 Mar25
Placeuro Gold Mines - PARTS C - Capi

Pondérations

	Valeur	Poche	Poids
1	DOM Finance - DOM Patrimoine-Part I	Multigestion	17,70 %
2	DOM SELECTION ACTION MIDCAP	Multigestion	11,23 %
3	FUT EUROSTOXX VGH5 Mar25	Future action	9,04 %
4	DOM PATRIMOINE - Part R	Multigestion	7,06 %
5	DOM CAPI	Multigestion	6,08 %
6	DOM Alpha Obligation Credit-Part C	Multigestion	6,05 %
7	DOM Selection Action Rendement-Part C	Multigestion	5,43 %
8	BDL Convictions 4D	Multigestion	5,39 %
9	Indépendance ET expansion - Europe	Multigestion	4,99 %
10	Placeuro Gold Mines - PARTS C - Capi	Multigestion	4,63 %

● Fonds actions ● Fonds mixtes ● Fonds obligataires



Poids des 10 premières positions : 77,58%

Les meilleures performances en €

	Valeur	Variation (€)	Variation
1	DOM SELECTION ACTION MIDC...	9 023,28	0,28 %
2	Indépendance ET expansion - E...	5 508,08	0,17 %
3	Quadrigé Rendement France M...	2 871,52	0,09 %
4	Gay-Lussac Microcaps Europe	1 770,60	0,05 %
5	Aberdeen -China A Share Equit...	1 458,58	0,04 %

Les moins bonnes performances en €

	Valeur	Variation (€)	Variation
1	Placeuro Gold Mines - PARTS C ...	-12 605,40	-0,39 %
2	DOM Finance - DOM Patrimoin...	-6 644,43	-0,20 %
3	Regnan Sustainable Water & W...	-5 500,70	-0,17 %
4	Immobilier 21-Part AC	-5 243,94	-0,16 %
5	Banque St-Olive BSO Bio Sante	-4 653,60	-0,14 %

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.