

juillet 2024 (données au 31/07/2024)

Le fonds Dôm Quantalys 60 a recours à la multigestion. Le profil 60 est un profil équilibré. 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 fournie par Quantalys France.

Commentaire de gestion



Grégory Olszowy
Gérant

La Réserve fédérale (FED) a maintenu ses taux directeurs inchangés dans la fourchette de 5,25 % à 5,50 %, comme prévu. Lors de son intervention, M. Powell a laissé entendre une possible baisse des taux en septembre, en soulignant les progrès en matière de désinflation et la résilience de l'économie américaine. Cette perspective a entraîné une détente des taux souverains, avec une baisse à 4,05 % pour le taux à 10 ans. Malgré cela, le dollar est resté stable face à l'euro, ainsi que les cours du pétrole qui se maintiennent autour de 82 dollars le baril.

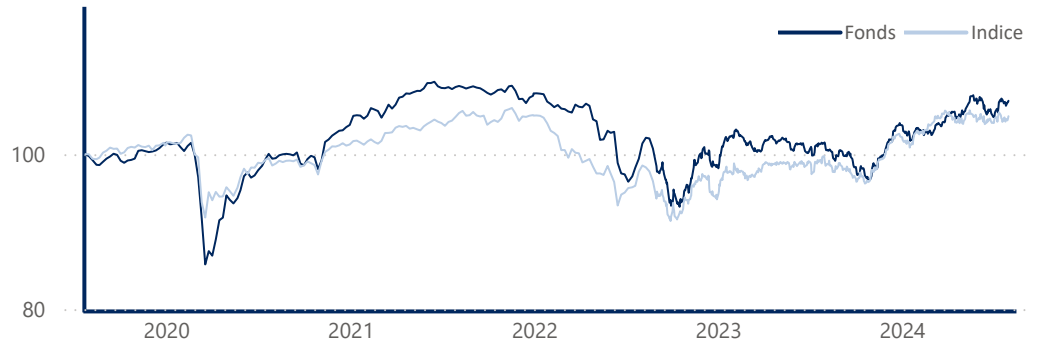
De son côté, la Banque centrale européenne (BCE) a également maintenu ses taux inchangés, avec un taux de dépôt à 3,75 % et un taux de refinancement à 4,25 %. Mme Lagarde, lors de sa conférence de presse, n'a pas exclu une possible baisse des taux pour mi-septembre.

Par ailleurs, les résultats des entreprises ont généralement déçu les investisseurs, qui étaient probablement trop optimistes. Les valeurs de secteurs comme le luxe (LVMH et KERING), l'automobile (STELLANTIS et BMW) et l'aérien (LUFTHANSA et RYANAIR) ont souffert.

Dans ce contexte, les marchés actions s'affichent en légère baisse sur le mois de -0,29% pour l'Eurostoxx 50 et de -0,73% pour le Nasdaq qui a plus souffert sur la deuxième partie du mois.

Le fonds varie de 1,66% sur le mois de juillet, portant la performance depuis le début de l'année à 3,00%. La volatilité se situe à 4,68%.

Evolution du fonds sur 5 ans (Base 100)



Performances cumulées

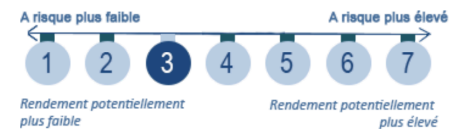
| Nom | Fonds | Indice |
|-------------|----------|---------|
| 1 mois | 1,66 % | 0,84 % |
| 1er janvier | 3,00 % | 2,56 % |
| 1 an | 5,36 % | 5,17 % |
| 3 ans | -1,64 % | 0,09 % |
| 5 ans | 6,90 % | 4,91 % |
| Création | -29,01 % | 36,00 % |

Indicateurs de risque

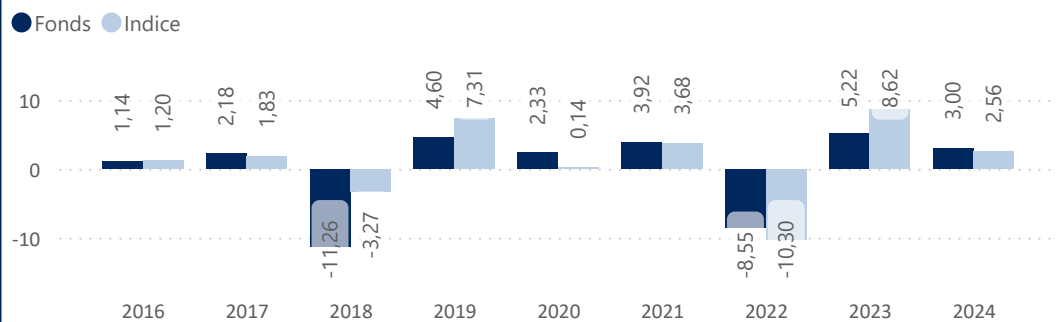
| Nom | 1 an | 3 ans | 5 ans |
|---------------------|-------|-------|-------|
| Volatilité fonds | 4,68% | 5,90% | 7,07% |
| Ratio de Sharpe | 0,65 | -0,48 | -0,14 |
| Ratio d'information | 0,40 | -0,49 | 0,32 |

Performances annualisées

| | | |
|----------|---------|--------|
| 3 ans | -0,55 % | 0,03 % |
| 5 ans | 1,34 % | 0,96 % |
| Création | -1,89 % | 1,72 % |



Historique des performances annuelles (%)



Valeur Liquidative

70,99 €

Encours de l'OPCVM

2 012 575 €

Caractéristiques du fonds

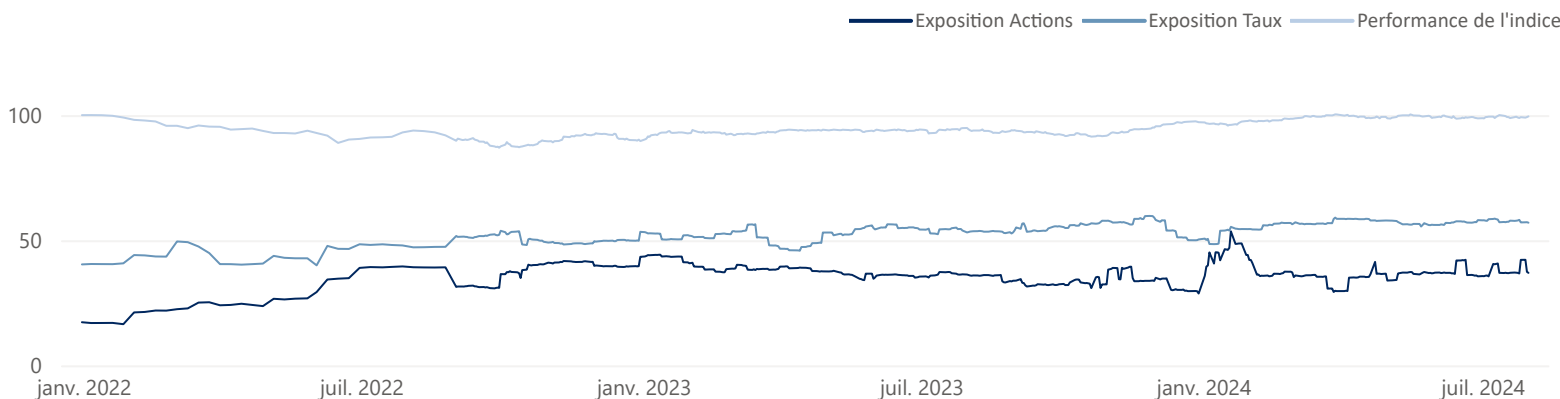
Date de création : 10 août 2006
Code ISIN : FR0010313734
Indice de référence : 30% ESTER, 40% Euro MTS 5-7, 30% Eurostoxx 50 dividendes nets réinvestis
Devise de référence : Euro
Affectation du résultat : Capitalisation
Classification : FCP mixte
Durée de placement conseillée : 5 ans
Eligible au PEA : 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 : 36,96% / 57,01%



Principaux mouvements du mois

Achats / Renforcements

FUT EUROSTOXX Sept24 VGU4

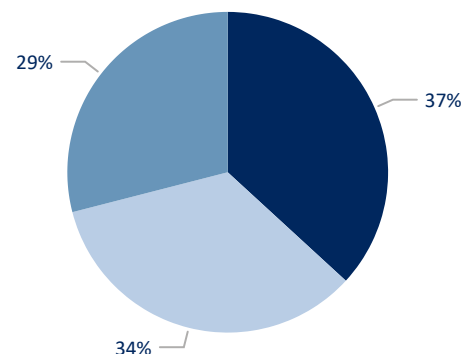
Ventes / Allègements

FUT EUROSTOXX Sept24 VGU4

Pondérations

| | Valeur | Poche | Poids |
|----|---------------------------------------|--------------|---------|
| 1 | DOM Alpha Obligation Credit-Part C | Multigestion | 15,09 % |
| 2 | DOM CAPI | Multigestion | 14,85 % |
| 3 | DOM Finance - DOM Patrimoine-Part I | Multigestion | 13,71 % |
| 4 | DOM PATRIMOINE - Part R | Multigestion | 12,45 % |
| 5 | DOM SELECTION ACTION MIDCAP | Multigestion | 5,66 % |
| 6 | Placeuro Gold Mines - PARTS C - Capi | Multigestion | 5,55 % |
| 7 | BDL Convictions 4D | Multigestion | 5,38 % |
| 8 | DOM Selection Action Rendement-Part C | Multigestion | 4,38 % |
| 9 | Banque St-Olive BSO Bio Sante | Multigestion | 3,34 % |
| 10 | Immobilier 21-Part AC | Multigestion | 2,68 % |

● Fonds obligataires ● Fonds actions ● Fonds mixtes



Poids des 10 premières positions : 83,10%

Les meilleures performances en €

| | Valeur | Variation (€) | Variation |
|---|-----------------------------------|---------------|-----------|
| 1 | Placeuro Gold Mines - PARTS C ... | 9 642,68 | 0,49 % |
| 2 | DOM Alpha Obligation Credit-P... | 7 444,33 | 0,38 % |
| 3 | DOM Finance - DOM Patrimoin... | 5 939,66 | 0,30 % |
| 4 | BDL Convictions 4D | 5 572,06 | 0,28 % |
| 5 | DOM PATRIMOINE - Part R | 5 324,40 | 0,27 % |

Les moins bonnes performances en €

| | Valeur | Variation (€) | Variation |
|---|----------------------------------|---------------|-----------|
| 1 | Gemway Assets - Gemchina | -837,00 | -0,04 % |
| 2 | DOM Selection Action Rendem... | -734,40 | -0,04 % |
| 3 | Aberdeen -China A Share Equit... | -178,43 | -0,01 % |
| 4 | DOM SELECTION ACTION MIDC... | -107,47 | -0,01 % |
| 5 | DOM Selection Action Rendem... | -4,13 | -0,00 % |

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.