

VANTAGE PLUS DIVERSIFIÉ

OCTOBRE 2017

ORIENTATION DE GESTION

Vantage Plus Diversifié est un fonds qui vise l'optimisation du couple rendement / risque sur la période de placement recommandé (3 à 5 ans) en se fondant sur une allocation d'actifs discrétionnaire et diversifiée sur grandes classes d'actifs.

CARACTÉRISTIQUES

Code ISIN: FR0010832162

Forme juridique: FCP de droit français

Date de création: 30/12/2009

Société de gestion: Amilton Asset Management

Classification AMF: Diversifié

Dépositaire: CACEIS Bank France

Valorisation: Quotidienne

Durée de placement conseillée: 3 à 5 ans

FRAIS

Frais de gestion: 2,40% max TTC

Commission de surperformance: 0%

CHIFFRES CLÉS

VL au 31/10/2017: 114,27€

Actif net au 31/10/2017: 56,0 M€

PROFIL DE RISQUE



Risque plus faible ← Risque plus élevé

← Rendement typiquement plus faible / Rendement typiquement plus élevé →

Performance		Volatilité	Exposition nette		
1 mois	2017 YTD	3 ans	% Actions	% Obligations	% Perf. Abs.
1,08%	5,16%	6,0%	34,6%	27,0%	29,1%

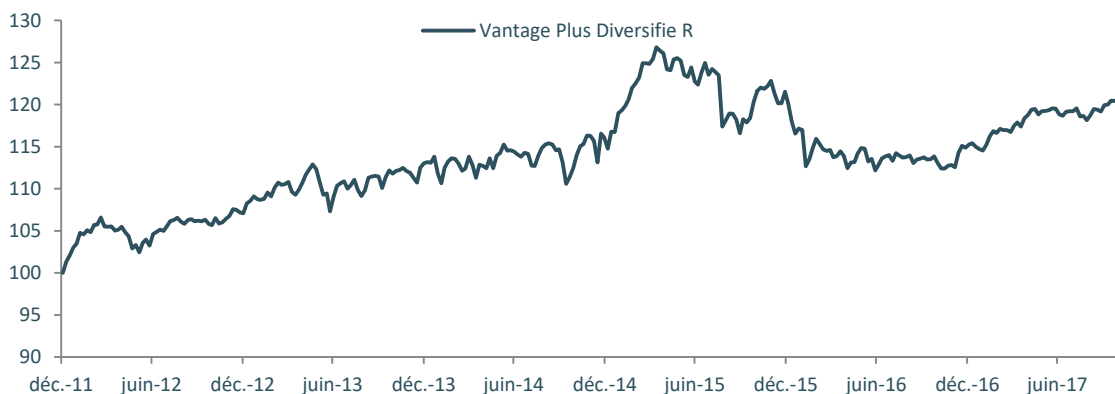
PERFORMANCES HISTORIQUES

Vantage Plus Diversifié	
1 mois	1,08%
3 mois	1,28%
6 mois	1,76%
1 an	6,76%
3 ans	5,40%
5 ans	14,29%
2017 YTD	5,16%
2016	-5,19%
2015	4,16%
2014	2,81%
2013	5,55%
2012	7,08%

INDICATEURS DE RISQUE

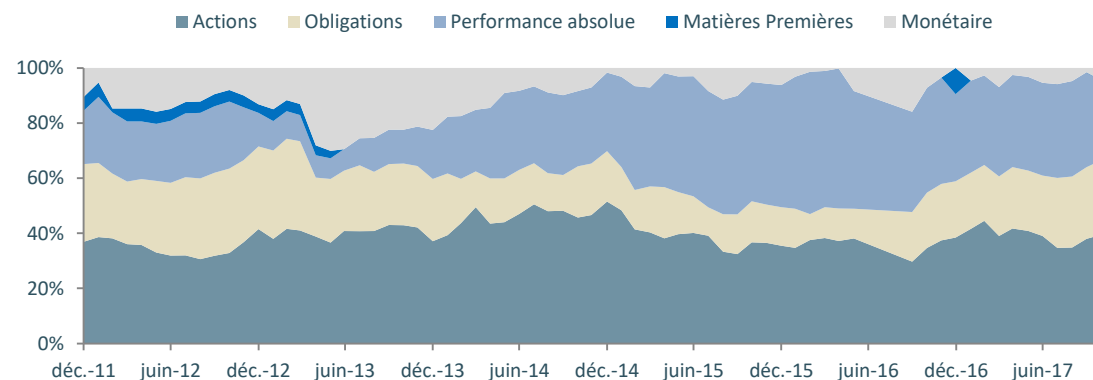
	1 an	3 ans
Volatilité fonds	3,7%	6,0%
Beta Actions	0,35	0,34
Beta Taux	0,12	0,50

ÉVOLUTION DE LA PERFORMANCE



Source : Thomson Reuters - Graphique en base 100 – Les performances passées ne constituent pas un indicateur fiable des performances futures

ÉVOLUTION DES EXPOSITIONS (HORS FUTURES ET OPTIONS)



RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE (AU 31/10/2017)

Catégories	Poids
Actions	39,5%
Actions - Europe	17,6%
Actions - US	10,8%
Actions - Pays Emergents	5,9%
Actions - Japon	2,4%
Actions - Sectorielles	2,8%
Obligations	27,0%
Obligations - Europe	13,0%
Obligations - Haut Rendement	4,1%
Obligations - US	3,6%
Obligations - Pays Emergents	3,7%
Obligations - Monde	2,6%
Performance Absolue / Diversifiés	29,1%
Alternatif - Long Short Actions	10,1%
Alternatif - Event Driven	6,6%
Alternatif - Diversifiés	6,5%
Allocation - Dynamique	2,8%
Allocation - Equilibré	3,1%
Liquidité	4,4%
Dérivés	8,5%
Contrat EURO/USD	11,6%
Contrat EURO/GBP	1,3%
Options sur Eurostoxx	-4,9%
Options sur EUR/USD	0,5%

PRINCIPALES LIGNES

	Poids
Ishares Msci Europe	7,1%
Lyxor Etf Dj Euro Stoxx 50	5,8%
Ossiam Shiller Brly Cape Usd	4,4%
Exane Intégrale F	4,1%
Candriam Bonds Credit Opportunities	4,0%
Spdr S&P 500 Etf	3,9%
Old Mutual UK Specialist Equity Fund	3,7%
Tf Float 10/31/18 Govt	3,7%
Reyl Emerging Markets	3,7%
Helium Selection Part S	3,4%
% 10 premières lignes	43,8%
% Titres en direct	29%
% OPCVM	71%
Nombre de lignes en portefeuille	41

MEILLEURES PERFORMANCES

	1 mois	YTD
Ishares Msci Japan Eur Hedged	6,2%	16,3%
Polar Uk Abs Equity Fund I Eurh	5,9%	40,2%
Msci Emerging Market	4,6%	18,2%
Assgen 5 06/08/48	4,2%	14,6%
Edf 5% 14-prep	3,9%	18,8%

MOINS BONNES PERFORMANCES

	1 mois	YTD
Gilead Sciences Inc	-7,5%	4,7%
Roche Holding	-6,8%	-0,9%
Oclaro Inc	-4,2%	-7,60%
Exane Intégrale F	-1,5%	-
Lyxor Etf Dj Stoxx 600 Banks	-1,2%	13,8%

PRINCIPAUX MOUVEMENTS

Entrées	Sorties
	Gemalto
	Octo Tresco-Credit
	Amber Equity Fund
	G Fund Alpha Fixed Income

EXPOSITION DEVISES

