

VANTAGE PLUS DIVERSIFIÉ

SEPTEMBRE 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 29/09/2017: 113,05€

Actif net au 29/09/2017: 57,6M€

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.
0,36%	4,04%	6,3%	34,5%	26,0%	34,5%

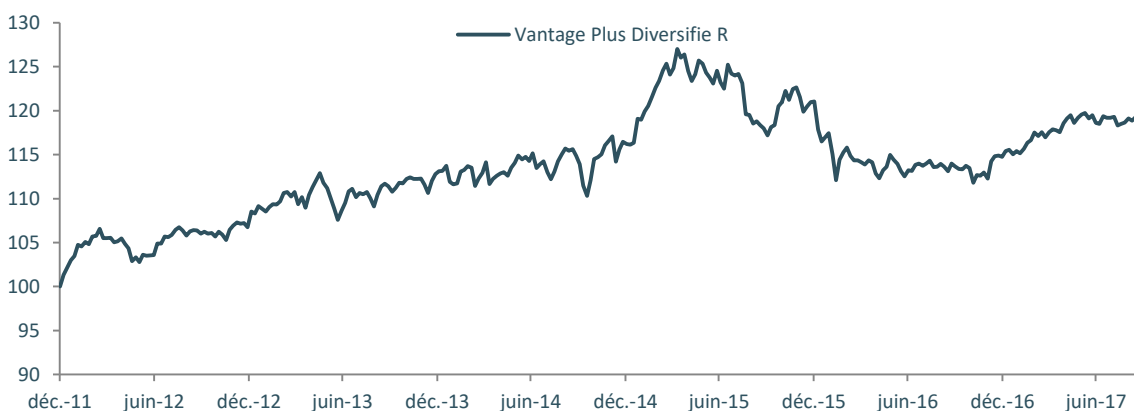
PERFORMANCES HISTORIQUES

Vantage Plus Diversifié	
1 mois	0,36%
3 mois	0,66%
6 mois	1,57%
1 an	5,06%
3 ans	4,10%
5 ans	12,60%
2017 YTD	4,04%
2016	-5,19%
2015	4,16%
2014	2,81%
2013	5,55%
2012	7,08%

INDICATEURS DE RISQUE

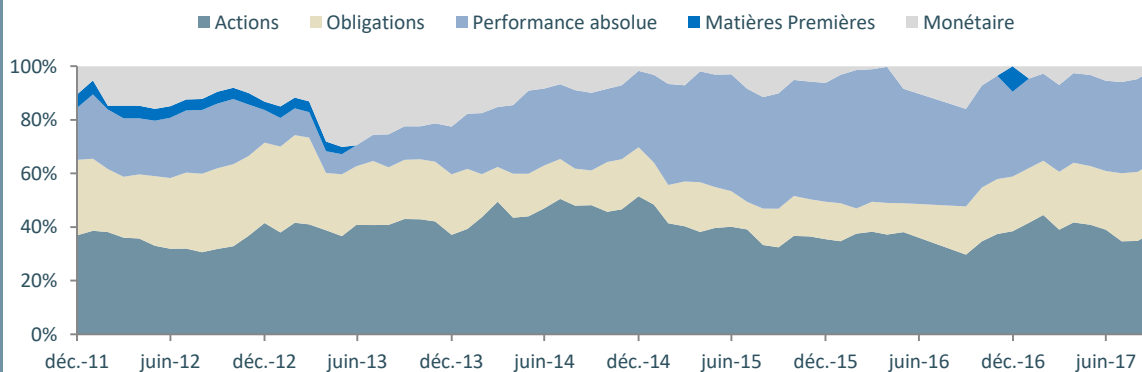
	1 an	3 ans
Volatilité fonds	3,8%	6,3%
Beta Actions	0,35	0,36
Beta Taux	0,00	0,29

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 29/09/2017)

Catégories	Poids
Actions	38,0%
Actions - Europe	17,2%
Actions - US	10,3%
Actions - Pays Emergents	5,6%
Actions - Japon	2,1%
Actions - Sectorielles	2,8%
Obligations	26,0%
Obligations - Europe	12,5%
Obligations - Haut Rendement	4,0%
Obligations - US	3,5%
Obligations - Pays Emergents	3,5%
Obligations - Monde	2,5%
Performance Absolue / Diversifiés	34,5%
Alternatif - Long Short Actions	13,2%
Alternatif - Long Short Taux	1,5%
Alternatif - Event Driven	7,6%
Alternatif - Diversifiés	6,6%
Allocation - Dynamique	2,7%
Allocation - Equilibré	2,9%
Liquidité	1,5%
Dérivés	7,2%
Contrat EURO/USD	11,2%
Contrat EURO/GBP	1,3%
Options sur Eurostoxx	-3,5%
Options sur EUR/USD	-0,5%

PRINCIPALES LIGNES

	Poids
Ishares Msci Europe	6,8%
Lyxor Etf Dj Euro Stoxx 50	5,5%
Helium Selection Part S	4,5%
Exane Intégrale F	4,3%
Ossiam Shiller Brly Cape Usd	4,1%
Candriam Bonds Credit Opportunities	3,9%
Spdr S&P 500 Etf	3,7%
Polar Uk Abs Equity Fund I Eurh	3,7%
Tf Float 10/31/18 Govt	3,5%
Old Mutual Uk Specialist Equity Fund	3,5%
% 10 premières lignes	43,5%
% Titres en direct	12,2%
% OPCVM	87,2%
Nombre de lignes en portefeuille	45

MEILLEURES PERFORMANCES

	1 mois	YTD
Lyxor Etf Dj Euro Stoxx 50	5,0%	8,9%
Ishares Msci Emu Small (Cesl Na)	5,0%	22,0%
Lyxor Etf Dj Stoxx 600 Banks	4,7%	14,5%
Ishares Msci Europe	4,1%	7,4%
Amilton Premium Part I	2,8%	26,3%

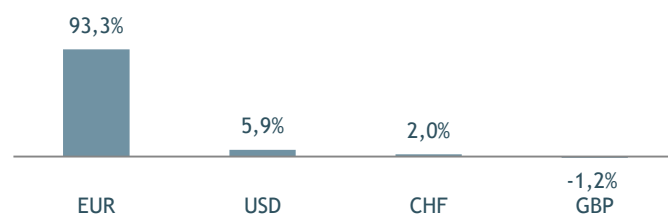
MOINS BONNES PERFORMANCES

	1 mois	YTD
Gilead Sciences Inc	-3,2%	13,1%
Old Mutual Uk Specialist Equity Fund	-3,0%	13,5%
Polar Uk Abs Equity Fund I Eurh	-1,8%	32,3%
Reyl Emerging Markets	-1,5%	7,3%
Ishares Euro High Yield Corporate Bond	-1,3%	0,6%

PRINCIPAUX MOUVEMENTS

Entrées	Sorties
Ishares MSCI Japan EUR Hedhed	Nordea-1 Stable Return
Old Mutual Global Eq Abs Return Fd	LFIS Vis Premia-Eb
Oak Emerg and Frnt Opp	

EXPOSITION DEVISES



AMILTON ASSET MANAGEMENT – SGP AGRÉMENT AMF N°GP95012 (WWW.AMF-FRANCE.ORG) – 49 BIS AVENUE FRANKLIN D. ROOSEVELT 75008 PARIS – 01 55 34 97 00 – WWW.AMILTON.COM

Avertissement : Ce document est établi par Amilton AM. Sa remise à tout investisseur relève de la responsabilité de chaque commercialisateur, distributeur ou conseil. Il a été réalisé dans un but d'information uniquement et ne constitue ni une offre ni une recommandation personnalisée ou une sollicitation en vue de la souscription d'un produit ou d'un service. Amilton AM attire l'attention des investisseurs sur le fait que tout investissement comporte des risques, notamment des risques de perte en capital. Amilton AM rappelle que préalablement à tout investissement, il est nécessaire de se rapprocher de son conseil pour évaluer et s'assurer de l'adéquation du produit ou du service en fonction de sa situation, de son profil et de ses objectifs. Les simulations et opinions présentées sur ce document sont le résultat d'analyses d'Amilton AM à un moment donné et ne préjugent en rien de résultats futurs. **Les performances passées ne constituent pas un indicateur fiable des performances futures** et ne sont pas constantes dans le temps. Les informations légales concernant les OPC, notamment les prospectus complets sont disponibles sur demande auprès de la société ou sur le site Internet www.amilton.com. Les informations contenues dans ce support sont issues de sources considérées comme fiables, à sa date d'édition.