

FCP (Fonds Commun de Placement)
de droit français

OPCVM relevant de la
Directive 2009/65 CE

OFI INVEST YIELD CURVES ABSOLUTE RETURN

Rapport semestriel au 28 juin 2024

Commercialisateur : **OFI INVEST AM**

Société de Gestion : **OFI INVEST AM**

Dépositaire et Conservateur : **SOCIETE GENERALE**

Gestion administrative et comptable : **SOCIETE GENERALE**

Commissaire aux comptes : **PricewaterhouseCoopers Audit**



Ofi invest Asset Management

Siège social : 22 Rue Vernier – 75017 Paris

Société Anonyme à Conseil d'Administration

au capital de 71 957 490 € - RCS Paris 384 940 342

ofi invest
Asset Management

INFORMATIONS RÉGLEMENTAIRES

Informations relatives à la transparence des opérations de financement sur titres et de la réutilisation des instruments financiers – Règlement SFTR

Le Fonds Ofi Invest Yield Curves Absolute Return n'a réalisé ni opération de financement sur titres, ni contrat d'échange sur rendement global au cours de la période.

État du patrimoine

Eléments de l'état du patrimoine	Montant à l'arrêté périodique
Titres financiers éligibles mentionnés au 1° du I de l'article L. 214-20 du code monétaire et financier	56 531 093,06
Avoirs bancaires	415 591,75
Autres actifs détenus par l'OPC	6 592 453,60
Total des actifs détenus par l'OPC	63 539 138,41
Comptes financiers	-24 055,40
Instruments financiers et Dettes	-714 708,26
Total des passifs	-738 763,66
Valeur nette d'inventaire	62 800 374,75

Evolution de l'actif net

	28/06/2024	29/12/2023	30/12/2022	31/12/2021	31/12/2020	31/12/2019
ACTIF NET						
en EUR	62 800 374,75	42 882 172,40	41 082 356,63	45 450 285,00	53 398 672,72	58 897 890,71
Nombre de titres						
Catégorie de parts A	69,0000	69,0000	69,0000	69,0000	141,9110	141,9110
Catégorie de parts C	20,0000	20,0000	20,0000	20,0000	20,0000	20,0000
Catégorie de parts I	121,6353	157,6353	168,9348	168,9348	180,7839	180,7839
Catégorie de parts R	56 458,0000	39 179,0000	39 179,0000	43 679,0000	51 592,0000	56 988,0000
Catégorie de parts AVIVA INVESTORS OBLIGATIONS VARIABLES E	-	-	-	-	-	-

Evolution de l'actif net (suite)

	28/06/2024	29/12/2023	30/12/2022	31/12/2021	31/12/2020	31/12/2019
Valeur liquidative unitaire						
Catégorie de parts A en EUR	106,77	105,13	101,24	100,89	100,93	101,37
Catégorie de parts C en EUR	1 093,63	1 074,89	1 031,36	1 024,04	1 020,74	1 021,47
Catégorie de parts I en EUR	1 096,17	1 077,40	1 033,78	1 026,47	1 027,08	1 033,88
Catégorie de parts R en EUR	1 109,45	1 089,45	1 043,41	1 035,95	1 030,74	1 029,62
Catégorie de parts AVIVA INVESTORS OBLIGATIONS VARIABLES E en EUR	-	-	-	-	-	-
Distribution unitaire sur plus et moins-values nettes (y compris les acomptes)						
en EUR	-	-	-	-	-	-
Distribution unitaire sur résultat (y compris les acomptes)						
Catégorie de parts I en EUR	-	-	-	3,95	5,86	9,05
Date de distribution	-	-	-	23/03/2021	17/03/2020	19/03/2019
Crédit d'impôt unitaire transféré au porteur (personnes physiques)						
Catégorie de parts A en EUR	-	-	-	-	-	-
Catégorie de parts C en EUR	-	-	-	-	-	-
Catégorie de parts I en EUR	-	-	-	-	-	-
Catégorie de parts R en EUR	-	-	-	-	-	-
Catégorie de parts AVIVA INVESTORS OBLIGATIONS VARIABLES E en EUR	-	-	-	-	-	-

Evolution de l'actif net (suite)

	28/06/2024	29/12/2023	30/12/2022	31/12/2021	31/12/2020	31/12/2019
Capitalisation unitaire						
Catégorie de parts A en EUR	-	1,84	3,87	-0,89	-0,11	-0,93
Catégorie de parts C en EUR	-	22,69	43,20	-5,30	2,51	-5,64
Catégorie de parts I en EUR	-	31,90	-4,22	-5,26	-1,45	-11,66
Catégorie de parts R en EUR	-	34,18	-2,38	-5,30	-1,42	-3,84
Catégorie de parts AVIVA INVESTORS OBLIGATIONS VARIABLES E en EUR	-	-	-	-	-	-

Portefeuille titres

Eléments du portefeuille titres	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Les titres financiers éligibles et des instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier	80,10	79,17
Actions	-	-
Obligations	80,10	79,17
CAISSE CENT CREDIT IMMOB 0.05% 25/03/2025	0,78	0,77
DEVLOPMENT BANK OF JAPAN 0.875% 10/10/2025	7,75	7,66
FRANCE 0.1% i 01/03/2026	10,51	10,39
FRANCE 2.75% 25/02/2029	2,86	2,83
FRANCE GOVT OF 3% 25/05/2054	1,15	1,13
FRANCE OAT i 0.7% 25/07/2030	3,18	3,14
FRANCE i 0.1% 01/03/2029	3,63	3,59
FRENCH REPULIC 0.10% i 25/07/2031	13,65	13,50
INVESTITIONSBANK BERLIN 0.25% 29/11/2024	4,25	4,20
ITALY 3.4% 28/03/2025	2,41	2,38
KINGDOM OF SPAIN 0% 31/05/2025	5,40	5,34
LAND NORDRHEIN WESTFALEN 3.4% 07/03/2073	4,29	4,24
ONTARIO TEACHERS FINANCE 0.5% 06/05/2025	4,66	4,60
PROVINCE OF ALBERTA 0.625% 16/01/2026	3,07	3,03
REGION WALLONNE 3.5% 15/03/2043	3,68	3,64
REPUBLIC OF SLOVENIA 2.125% 28/07/2025	8,84	8,73
Titres de créances	-	-
Les titres financiers éligibles et des instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen	-	-
Actions	-	-
Obligations	-	-
Titres de créances	-	-

Portefeuille titres (suite)

Eléments du portefeuille titres	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Les titres financiers éligibles et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières	9,91	9,80
Actions	-	-
Obligations	9,91	9,80
UNITED STATES OF AMERICA i 2.125% 15/04/2029	9,91	9,80
Titres de créances	-	-
Les titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier	-	-
Actions	-	-
Obligations	-	-
Titres de créances	-	-
Les autres actifs : Il s'agit des actifs mentionnés au II de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier	7,64	7,55
OPC à capital variable	7,64	7,55
OFI INVEST ESG LIQUIDITÉS I	4,53	4,47
OFI INVEST ISR CRÉDIT COURT EURO R	3,11	3,07
Actions	-	-
Obligations	-	-
Titres de créances	-	-

Indication des mouvements intervenus dans la composition du portefeuille titres, au cours de la période de référence

Eléments du portefeuille titres	Mouvements (en montant)	
	Acquisitions	Cessions
Les titres financiers éligibles et des instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier	49 921 417,84	35 707 494,69
Actions	-	-
Obligations	49 921 417,84	35 707 494,69
Titres de créances	-	-
Les titres financiers éligibles et des instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen	-	-
Actions	-	-
Obligations	-	-
Titres de créances	-	-

Indication des mouvements intervenus dans la composition du portefeuille titres, au cours de la période de référence (suite)

Eléments du portefeuille titres	Mouvements (en montant)	
	Acquisitions	Cessions
Les titres financiers éligibles et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières	15 076 918,65	11 001 609,02
Actions	-	-
Obligations	15 076 918,65	11 001 609,02
Titres de créances	-	-
Les titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier	-	-
Actions	-	-
Obligations	-	-
Titres de créances	-	-
Les autres actifs : Il s'agit des actifs mentionnés au II de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier	16 483 458,77	14 745 893,85
OPC à capital variable	16 483 458,77	14 745 893,85