

FCP (Fonds Commun de Placement)
de droit français

OPCVM relevant de la
Directive 2009/65 CE

OFI INVEST YIELD CURVE ABSOLUTE RETURN

Rapport semestriel au 30 juin 2023

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 335 133 229

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

Éléments 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	35 854 575,03
Avoirs bancaires	2 095 589,96
Autres actifs détenus par l'OPC	10 876 500,54
Total des actifs détenus par l'OPC	48 826 665,53
Comptes financiers	-132 027,29
Instruments financiers et Dettes	-6 980 219,70
Total des passifs	-7 112 246,99
Valeur nette d'inventaire	41 714 418,54

Evolution de l'actif net

	30/06/2023	30/12/2022	31/12/2021	31/12/2020	31/12/2019	31/12/2018
ACTIF NET						
en EUR	41 714 418,54	41 082 356,63	45 450 285,00	53 398 672,72	58 897 890,71	129 273 507,68
Nombre de titres						
Catégorie de parts A	69,0000	69,0000	69,0000	141,9110	141,9110	141,9110
Catégorie de parts C	20,0000	20,0000	20,0000	20,0000	20,0000	20,0000
Catégorie de parts I	168,9348	168,9348	168,9348	180,7839	180,7839	705,6801
Catégorie de parts R	39 179,0000	39 179,0000	43 679,0000	51 592,0000	56 988,0000	126 281,0000
Valeur liquidative unitaire						
Catégorie de parts A en EUR	102,52	101,24	100,89	100,93	101,37	100,74
Catégorie de parts C en EUR	1 046,27	1 031,36	1 024,04	1 020,74	1 021,47	1 011,41
Catégorie de parts I en EUR	1 048,72	1 033,78	1 026,47	1 027,08	1 033,88	1 032,74
Catégorie de parts R en EUR	1 059,47	1 043,41	1 035,95	1 030,74	1 029,62	1 017,65

Evolution de l'actif net (suite)

	30/06/2023	30/12/2022	31/12/2021	31/12/2020	31/12/2019	31/12/2018
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	5,79
Date de distribution	-	-	23/03/2021	17/03/2020	19/03/2019	20/03/2018
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	-	-	-	-	-	-
Capitalisation unitaire						
Catégorie de parts A en EUR	-	3,87	-0,89	-0,11	-0,93	-0,41
Catégorie de parts C en EUR	-	43,20	-5,30	2,51	-5,64	-0,39
Catégorie de parts I en EUR	-	-4,22	-5,26	-1,45	-11,66	-9,46
Catégorie de parts R en EUR	-	-2,38	-5,30	-1,42	-3,84	1,43

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	81,39	69,53
Actions	-	-
Obligations	81,39	69,53
BELGIUM 3% 22/06/2033	2,68	2,29
CAISSE CENT CREDIT IMMOB 0.05% 25/03/2025	4,51	3,85
CASSA DEPOSITI E PRESTIT SPA 1.5% 21/06/2024	4,68	4,00
DEVELOPMENT BK OF JAPAN 0.01% 15/10/2024	4,55	3,89
DEXIA CREDIT LOCAL 0% 29/05/2024	8,10	6,92

Portefeuille titres (suite)

Éléments du portefeuille titres	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
EFSF 2.375% 11/04/2028	4,65	3,97
ESSILORLUXOTTICA 0.375% 27/11/2027	1,05	0,90
FEDERAL REPUBLIC OF GERMANY 0% 15/05/2035	1,69	1,45
FEDERAL REPUBLIC OF GERMANY VAR 16/04/2027	4,96	4,24
FRANCE GOVT OF 3% 25/05/2054	1,87	1,60
FRANCE OAT i 0.7% 25/07/2030	4,84	4,13
FRANCE i 0.1% 01/03/2029	5,24	4,47
FRENCH REPUBLIC 0.10% i 25/07/2031	2,46	2,10
JUNTA DE EXREMADURA 3.875% 14/03/2024	4,84	4,14
LAND NORDRHEIN WESTFALEN 3.4% 07/03/2073	3,00	2,56
NRW BANK 0.25% 16/03/2027	3,86	3,30
PROVINCE OF ONTARIO 0.375% 14/06/2024	4,64	3,96
REGION WALLONNE 3.25% 22/06/2033	3,77	3,22
REPUBLIC OF ITALY i 0.40% 15/05/2030	4,03	3,45
SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 3.625% 08/06/2033	5,96	5,09
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	-	-
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	4,56	3,90
Actions	-	-
Obligations	4,56	3,90
USA 0.25% 30/09/2023	4,56	3,90
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	7,31	6,24
OPC à capital variable	7,31	6,24
AVIVA INVESTORS MONETAIRE D	0,33	0,28
OFI INVEST ISR CRÉDIT COURT EURO R	6,98	5,96

Portefeuille titres (suite)

Éléments du portefeuille titres	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
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	29 141 503,82	27 690 947,34
Actions	-	-
Obligations	29 141 503,82	27 690 947,34
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	-	-
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	1 910 370,70	-
Actions	-	-
Obligations	1 910 370,70	-
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	-	876 950,24
OPC à capital variable	-	876 950,24