

ES Ofi Invest ISR Actions Euro

FRO014005B87 S

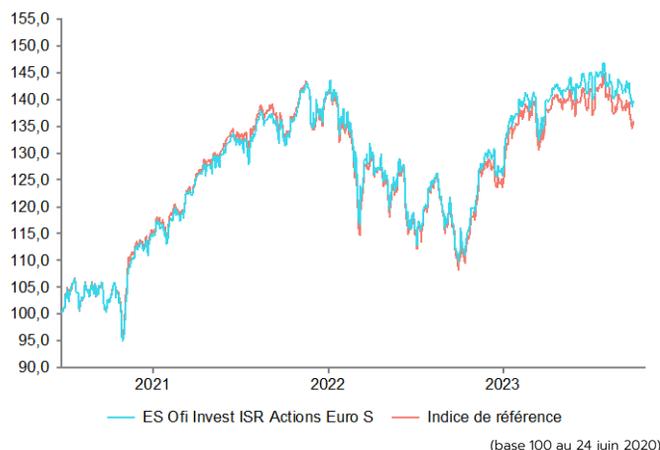
Reporting trimestriel au 29 septembre 2023



■ Valeur liquidative : 16,16 €

■ Actif net du fonds : 4 030 717 €

■ Évolution de la performance



■ Performances cumulées

	1M	Ytd	1Y	3Y	5Y	8Y	10Y
Fonds	-2,4%	11,2%	25,9%	37,1%	-	-	-
Indicateur de référence	-3,1%	10,0%	23,9%	33,2%	-	-	-

■ Performances annuelles

	2017	2018	2019	2020	2021	2022
Fonds	-	-	-	-	23,3%	-10,8%
Indicateur de référence	-	-	-	-	22,7%	-12,3%

Les performances passées ne préjugent pas des performances futures. La valeur d'un investissement dans l'OPC peut fluctuer à la hausse comme à la baisse. Les performances présentées s'entendent dividendes/coupons réinvestis. Le calcul de performance des indices composés de plusieurs indices est rebalancé tous les mois.

■ Principaux indicateurs de risque *

	Fonds		Indice de référence				
Max drawdown (1)	-23,7		-24,6				
Délai de recouvrement (1)	232		301				
	1Y	3Y	5Y	8Y	10Y		
Ratio de Sharpe *	1,38	0,59	-	-	-		
Ratio d'information *	1,12	0,57	-	-	-		
Tracking error *	1,42	1,63	-	-	-		
Volatilité fonds *	14,88	16,78	-	-	-		
Volatilité indice *	15,43	17,30	-	-	-		

* Source : Six Financial Information

1) sur (156 semaines (arrêté au dernier vendredi du mois)

■ Notation(s)

Six Financial Information

—

■ Date de création

31 mars 2020

■ Catégorisation SFDR

Article 8

■ Forme juridique

FCPE de droit français

■ Devise

EUR (€)

■ Intensité carbone

Fonds	Indice
85,46	111,07

■ Couverture intensité carbone

Fonds	Indice
99,96%	99,78%

Tonne(s) de CO2 par million de \$ de revenus (source : BRS & MSCI)

■ Score ESG

Fonds	Indice
8,19	7,81

■ Couverture score ESG

Fonds	Indice
99,92%	99,78%

■ Dernier détachement

Date	Montant net
-	-

■ Orientation de gestion

Le FCPE, qui est un fonds nourricier de l'OPCVM Maître Ofi Invest ISR Actions Euro, est investi entre 85% et 100% de son actif net en parts I de l'OPCVM Maître. Le reste du portefeuille sera investi en liquidités dans la limite de 10% de l'actif net. Son objectif de gestion est identique à celui de l'OPCVM Maître, c'est-à-dire "en investissant principalement sur les marchés d'actions de la zone euro, le FCP a pour objectif de réaliser, sur la durée de placement recommandée de 5 ans, une performance supérieure à celle de l'indice EURO STOXX®, en appliquant notamment un filtre ISR (Investissement Socialement Responsable)."

La performance du FCPE nourricier pourra être inférieure à celle de l'OPCVM Maître du fait de la détention de liquidités et de ses frais de gestion financières propres.

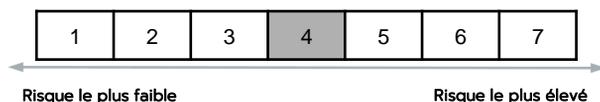
■ Indice de référence

EURO STOXX® (dividendes nets réinvestis)

■ Durée de placement minimum recommandée

5 ans

■ Profil de risque



SRI (Synthetic Risk Indicator) : L'indicateur synthétique de risque permet d'apprécier le niveau de risque de ce produit par rapport à d'autres. Il indique la probabilité que ce produit enregistre des pertes en cas de mouvements sur les marchés ou d'une impossibilité de notre part de vous payer. L'indicateur de risque part de l'hypothèse que vous conservez le produit pendant la durée de placement minimum recommandée.

■ Gérant(s)

Eric Chatron

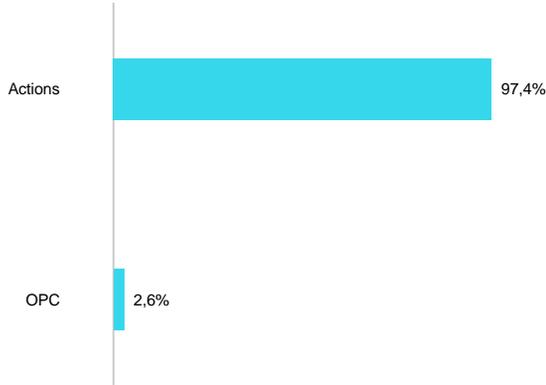


Anaëlle Guénolé

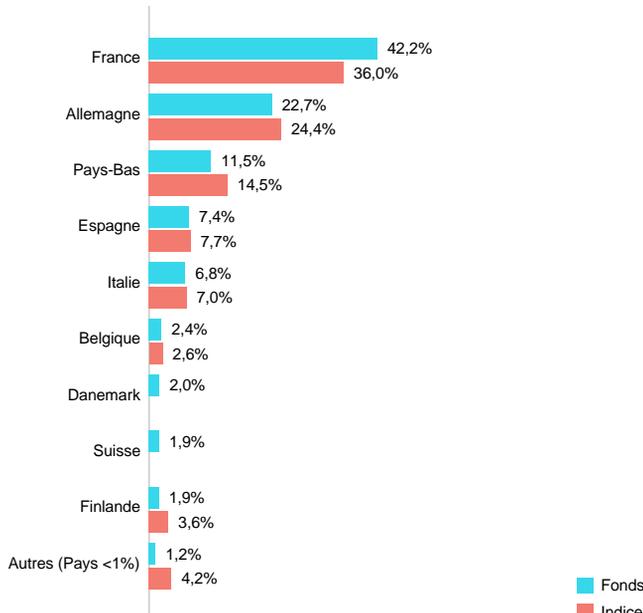




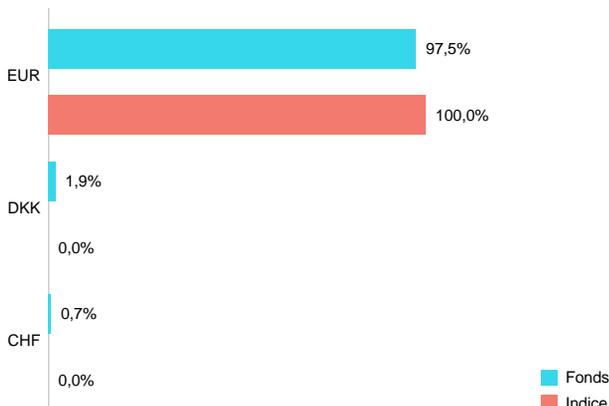
Répartition par type d'actif



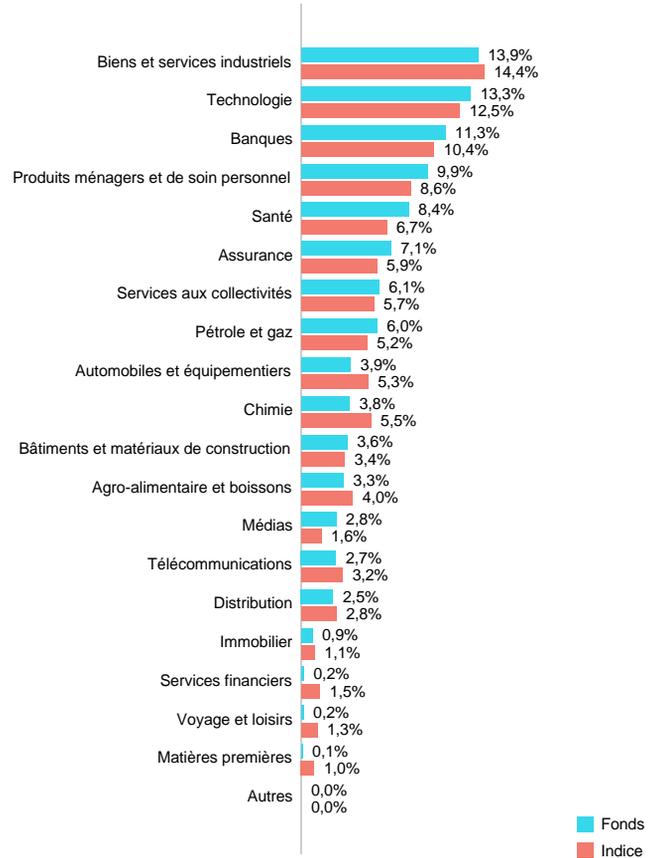
Répartition géographique



Répartition par devise



Répartition par secteur



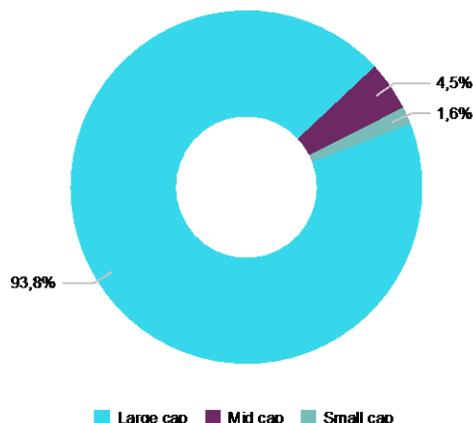
Principales positions

Nom	Pays	Secteur	% Actif
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	France	Produits ménagers et de soin personnel	5,0%
ASML HOLDING NV	Pays-Bas	Technologie	4,6%
TOTALENERGIES SE	France	Pétrole et gaz	3,8%
SAP SE	Allemagne	Technologie	3,2%
SANOFI SA	France	Santé	3,0%
SCHNEIDER ELECTRIC SE	France	Biens et services industriels	2,8%
SIEMENS AG	Allemagne	Biens et services industriels	2,5%
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS GESELLSCHAFT IN MUENCHEN AG	Allemagne	Assurance	2,4%
LOREAL SA	France	Produits ménagers et de soin personnel	2,4%
ALLIANZ SE	Allemagne	Assurance	2,3%

Nombre total de lignes (action) : 88



■ Répartition par taille de capitalisation



Large cap : sup. 10 milliards €
 Mid cap : entre 500 millions et 10 milliards €
 Small cap : inf. 500 millions €.

La ventilation concerne les actions détenues en direct et par transposition.

■ Commentaire de gestion

Les marchés actions se sont repliés au mois de septembre avec des inquiétudes de dégradation de l'économie du Vieux Continent, plus particulièrement de l'économie allemande. Les cours du baril du pétrole sont repassés au-dessus de 95 dollars risquant de venir enrayer la dynamique de baisse de l'inflation. Surtout, la nouvelle hausse des rendements obligataires a pesé sur les valorisations boursières, notamment les actions les mieux valorisées dans les secteurs du luxe et de la technologie.

Côté performances, le fonds enregistre une surperformance principalement expliquée par la bonne sélection de titres. Effectivement, même si le fonds a également bénéficié de son allocation sectorielle, l'absence de BAYER dans la santé ainsi que la surpondération sur MUNICH-RE dans l'assurance ont réussi à compenser la surpondération sur MTU AERO.

■ Principales surpondérations

Nom	Secteur	% Actif	Surpondération
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS GESELLSCHAFT IN MUENCHEN AG	Assurance	2,4%	1,4%
UNICREDIT SPA	Banques	2,1%	1,3%
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	Produits ménagers et de soin personnel	5,0%	1,2%
MERCEDES-BENZ GROUP AG	Automobiles et équipementiers	2,2%	1,1%
PRYSMIAN SPA	Biens et services industriels	1,3%	1,1%

■ Principales sous-pondérations

Nom	Secteur	% Actif	Sous-pondération
DEUTSCHE TELEKOM AG	Télécommunications	0,0%	-1,4%
BAYER AG	Chimie	0,0%	-0,9%
STELLANTIS NV	Automobiles et équipementiers	0,0%	-0,9%
INTESA SANPAOLO SPA	Banques	0,0%	-0,8%
BASF SE	Chimie	0,0%	-0,8%

ES Ofi Invest ISR Actions Euro

FRO014005B87 S

Reporting trimestriel au 29 septembre 2023



Principales caractéristiques

Société de gestion	Ofi invest Asset Management	Dépositaire	Société Générale S.A.
Code ISIN	FRO014005B87	Conservateur	Amundi ESR
Forme juridique	FCPE de droit français	Catégorisation SFDR	Article 8
Date de création	31 mars 2020	Droits d'entrée max	Néant
Durée de placement min. recommandée	5 ans	Frais de gestion max TTC	0.0%
Fréquence de valorisation	Journalière	Commission de surperformance	Non
Investissement min. initial	Néant	Publication des VL	www.amundi-ee.com
Investissement min. ultérieur	Néant	Commissaire aux comptes	KPMG Audit
Ticker Bloomberg	Non Administré	Affectation des résultats	Capitalisation
Indice de référence	EURO STOXX® (dividendes nets réinvestis)		

Définitions

La **Tracking error** est la mesure du risque relatif pris par un fonds par rapport à son indice de référence. Elle est donnée par l'écart type annualisé des performances relatives d'un fonds par rapport à son indice de référence. Plus elle est faible, plus le fonds possède un profil de risque proche de son indice de référence.

Le **Ratio de Sharpe** mesure l'écart de rendement d'un portefeuille par rapport au taux de rendement d'un placement sans risque (prime de risque), divisé par un l'écart type de la rentabilité de ce portefeuille (volatilité).

Un ratio de Sharpe élevé est un bon indicateur.

La perte maximale (**Max drawdown**) correspond au rendement sur la période de placement la plus mauvaise possible. Elle indique la perte maximale qu'un investisseur aurait pu subir s'il avait acheté le fonds au plus haut de la période d'observation et l'avait vendu au plus bas durant cette période.

L'**intensité carbone** représente le total des émissions de gaz à effet de serre (GES) des scopes 1 & 2 (émissions directes & émissions indirectes liées aux consommations énergétiques) normalisé par million de \$ de revenus (chiffre d'affaires). Ainsi, pour chaque million de dollar de revenus, X tonnes métriques d'émissions sont financées.

Contacts

Ofi Invest Asset Management : 22, rue Vernier - 75017 Paris

Tel : 01 40 68 17 17

Email : service.client@ofi-invest.com

Information importante

Ce document d'information ne peut être reproduit sous quelque forme que ce soit ou transmis à une autre personne que celle à qui il est adressé. Il est établi par Ofi Invest Asset Management, société de gestion de portefeuille (APE 6630Z) de droit français agréée par l'Autorité des Marchés Financiers (AMF) sous l'agrément n° GP 92-12 - FR 1384940342, Société Anonyme à Conseil d'Administration au capital de 71.957.490 euros, dont le siège social est situé au 22, rue Vernier 75017 Paris, immatriculée au Registre du Commerce et des Sociétés de Paris sous le numéro 384 940 342.

Ce document ne saurait être assimilé à une activité de démarchage, à une quelconque offre de valeur mobilière ou instrument financier que ce soit ou de recommandation d'en acheter ou d'en vendre, il contient des éléments d'information et des données chiffrées qu'Ofi Invest Asset Management considère comme fondés ou exacts au jour de leur établissement. Pour ceux de ces éléments qui proviennent de sources d'information publiques, leur exactitude ne saurait être garantie.

Les analyses présentées reposent sur des hypothèses et des anticipations d'Ofi Invest Asset Management, faites au moment de la rédaction du document qui peuvent être totalement ou partiellement non réalisées sur les marchés. Elles ne constituent pas un engagement de rentabilité et sont susceptibles d'être modifiées.

Ce document d'information ne donne aucune assurance de l'adéquation des produits ou services présentés à la situation ou aux objectifs de l'investisseur et ne constitue pas une recommandation, un conseil ou une offre d'acheter les produits financiers mentionnés. Ofi Invest Asset Management décline toute responsabilité quant à d'éventuels dommages ou pertes résultant de l'utilisation en tout ou partie des éléments y figurant.

La valeur d'un investissement sur les marchés peut fluctuer à la hausse comme à la baisse, et peut varier en raison des variations des taux de change. En fonction de la situation économique et des risques de marché, aucune garantie n'est donnée sur le fait que les produits ou services présentés puissent atteindre leurs objectifs d'investissement. Les performances passées ne préjugent pas des performances futures.

Les fonds présentés dans ce document d'information peuvent ne pas être enregistrés dans toutes les juridictions. Les fonds peuvent faire l'objet de restrictions à l'égard de certaines personnes ou dans certains pays en vertu des réglementations nationales applicables à ces personnes ou dans ces pays. Le Document d'Information Clé pour l'investisseur (DICI/DIC), le prospectus ainsi que les derniers états financiers disponibles des OPC gérés par Ofi Invest Asset Management, sont à la disposition du public sur simple demande, auprès d'Ofi Invest Asset Management.

Sources pour toutes les données : Ofi Invest Asset Management. Les OPC sous-jacents de la gamme Ofi Invest Asset Management détenus en portefeuille, sont calculés par transparence.