

ES Ofi Invest ISR Actions Euro

FRO014005B87 S

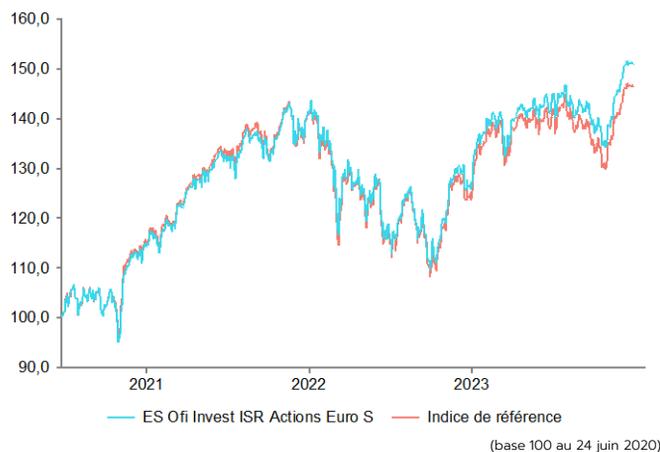
Reporting trimestriel au 29 décembre 2023



■ Valeur liquidative : 17,45 €

■ Actif net du fonds : 4 874 674 €

■ Évolution de la performance



■ Performances cumulées

| | 1M | Ytd | 1Y | 3Y | 5Y | 8Y | 10Y |
|-------------------------|------|-------|-------|-------|----|----|-----|
| Fonds | 2,9% | 20,1% | 20,1% | 32,1% | - | - | - |
| Indicateur de référence | 3,2% | 18,6% | 18,6% | 27,5% | - | - | - |

■ 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 * | 1,06 | 0,55 | - | - | - |
| Ratio d'information * | 0,80 | 0,71 | - | - | - |
| Tracking error * | 1,65 | 1,65 | - | - | - |
| Volatilité fonds * | 14,24 | 15,41 | - | - | - |
| Volatilité indice * | 15,04 | 16,19 | - | - | - |

* 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 81,46
Indice 110,21

■ Couverture intensité carbone

Fonds 99,95%
Indice 99,88%

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

■ Score ESG

Fonds 8,13
Indice 7,79

■ Couverture score ESG

Fonds 99,91%
Indice 99,88%

■ 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.

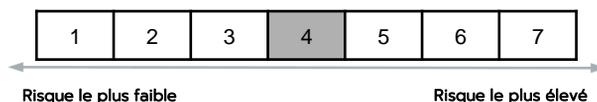
■ Indice de référence

EURO STOXX® (dividendes nets réinvestis)

■ Durée de placement minimum recommandée

5 ans

■ Profil de risque



Risque le plus faible

Risque le plus élevé

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

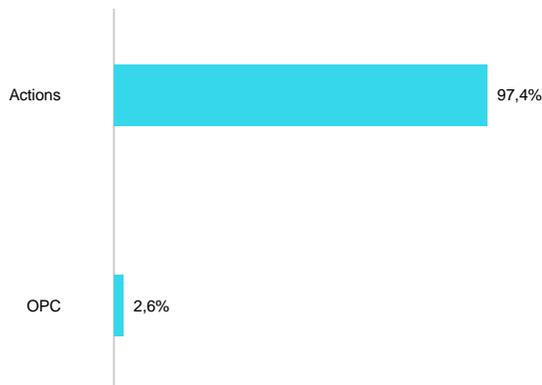


Anaëlle Guénolé

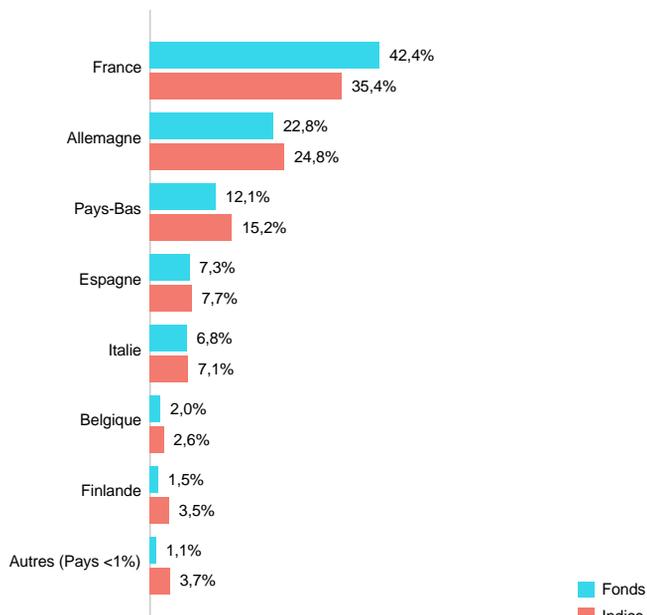




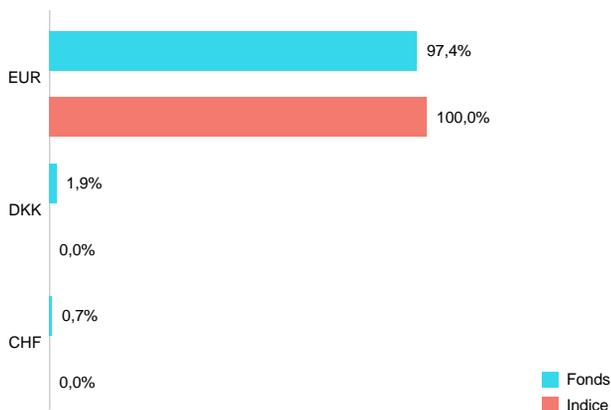
Répartition par type d'actif



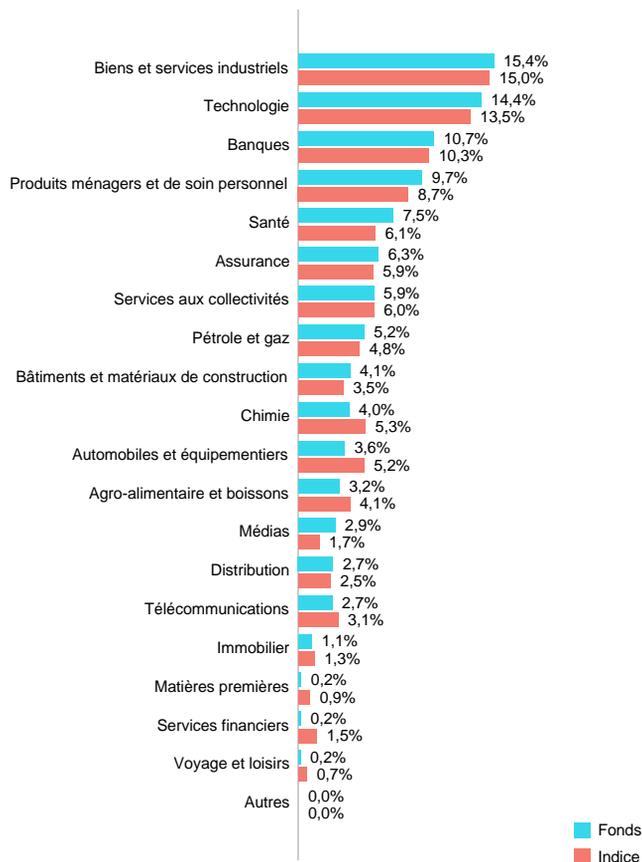
Répartition géographique



Répartition par devise



Répartition par secteur

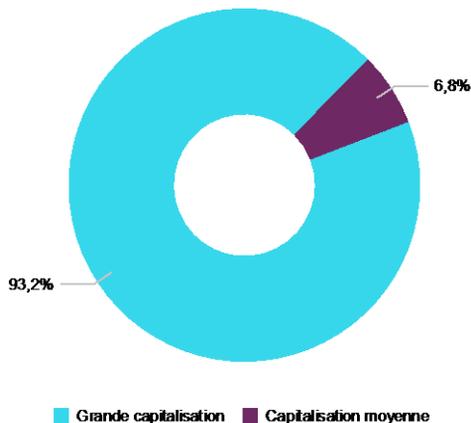


Principales positions

| Nom | Pays | Secteur | % Actif |
|---|-----------|--|---------|
| ASML HOLDING NV | Pays-Bas | Technologie | 5,3% |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | France | Produits ménagers et de soin personnel | 4,6% |
| TOTALENERGIES SE | France | Pétrole et gaz | 3,5% |
| SAP SE | Allemagne | Technologie | 3,1% |
| SIEMENS AG | Allemagne | Biens et services industriels | 3,1% |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE | France | Biens et services industriels | 3,0% |
| LOREAL SA | France | Produits ménagers et de soin personnel | 2,6% |
| SANOFI SA | France | Santé | 2,5% |
| ALLIANZ SE | Allemagne | Assurance | 2,3% |
| L AIR LIQUIDE SA POUR L ETUDE ET L EXPLO DES PROCEDES GEORGES CLAUDE SA | France | Chimie | 2,1% |



■ Répartition par taille de capitalisation



Grande capitalisation : sup. 10 milliards €
 Capitalisation moyenne : entre 500 millions et 10 milliards €
 Petite capitalisation : inf. 500 millions €.

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

■ Commentaire de gestion

Les actifs à risque ont poursuivi leur progression en décembre, terminant l'année en fanfare, notamment soutenus par les anticipations d'une baisse prochaine des taux des grandes Banques centrales. Portés par ce climat optimiste, le CAC 40, le DAX allemand, le Dow Jones ou encore le Nasdaq 100, à forte coloration technologique, ont signé le mois dernier de nouveaux records. Effectivement, les investisseurs ont été soulagés par le ralentissement de la hausse des prix et la résistance de l'économie américaine. Ainsi, pour ce dernier mois de l'année, le Stoxx 600 enregistre une hausse de +3,8% avec la quasi-totalité des secteurs dans le vert et une surperformance notable du Travel & Leisure (+11,3%), de l'Immobilier (+10,2%) et de la Construction (+7,8%).

Au cours de cette fin d'année, quelques ajustements ont été effectués au sein du portefeuille. Côté financières, bien qu'une ligne sur INTESA ait été créée, la surpondération au secteur a été réduite avec une prise de profit sur UNICREDIT, CAIXA et MUNICHRE. Par ailleurs, quelques profits ont également été pris sur NOVO NORDISK. Côté luxe, un léger arbitrage d'HERMES au détriment de LVMH a été initié, alors qu'au sein de l'aéronautique, les surpondérations sur MTU et THALES ont été réduites en faveur de SAFRAN.

■ Principales surpondérations

| Nom | Secteur | % Actif | Surpondération |
|------------------------------|--|---------|----------------|
| PRYSMIAN SPA | Biens et services industriels | 1,3% | 1,0% |
| COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN SA | Bâtiments et matériaux de construction | 1,7% | 1,0% |
| WOLTERS KLUWER NV | Médias | 1,6% | 1,0% |
| CAPGEMINI SE | Technologie | 1,6% | 1,0% |
| E.ON SE | Services aux collectivités | 1,4% | 1,0% |

■ Principales sous-pondérations

| Nom | Secteur | % Actif | Sous-pondération |
|---------------------|-------------------------------|---------|------------------|
| DEUTSCHE TELEKOM AG | Télécommunications | 0,0% | -1,5% |
| STELLANTIS NV | Automobiles et équipementiers | 0,0% | -0,9% |
| IBERDROLA SA | Services aux collectivités | 0,5% | -0,9% |
| BASF SE | Chimie | 0,0% | -0,9% |
| FERRARI NV | Automobiles et équipementiers | 0,0% | -0,7% |

ES Ofi Invest ISR Actions Euro

FR0014005B87 S

Reporting trimestriel au 29 décembre 2023



Principales caractéristiques

| | | | |
|-------------------------------------|--|------------------------------|--|
| Société de gestion | Ofi invest Asset Management | Dépositaire | Société Générale S.A. |
| Code ISIN | FR0014005B87 | 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 le plus mauvais 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.