

Ofi Invest ESG Liquidités C/D

Reporting Mensuel - Monétaire - février 2024



Ofi Invest ESG Liquidités est une FCP de trésorerie dont l'objectif est de réaliser une performance proche de l'indice ESTER Capitalisé + 5bps tout en conservant une volatilité inférieure à 0,50%. OFI RS Liquidités investit majoritairement dans des émetteurs qui ont des pratiques ESG en avance par rapport à leur secteur d'activité.

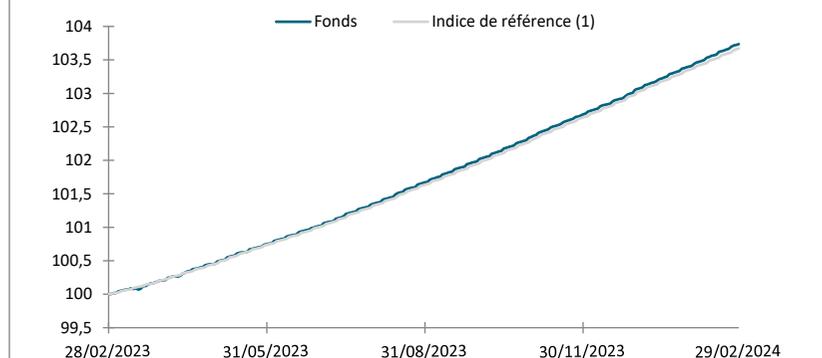
Chiffres clés au 29/02/2024

Valeur Liquidative (en euros) :	4 506,84
Actif net de la Part (en millions d'euros) :	3 995,82
Actif net total des Part (en millions d'euros) :	5 270,55
Performance YTD annualisée :	ESTER +18 bps
WAM <183 j	10 jours
WAL <365 j	168 jour(s)
Tracking error 10 ans :	0,08%

Caractéristiques du fonds

Code ISIN :	FR0000008997
Ticker :	OFMTRSR FP Equity
Classification AMF :	Monétaire à valeur liquidative variable (VNAV) standard
Classification SFDR :	Article 8
Classification Europerformance :	Trésorerie
Indice de référence ⁽¹⁾ :	ESTER Capitalisé + 5bps
Principaux risques :	Risques de capital et performances Risques de marchés : taux et crédit
Gérant(s) :	Emir HADZIC - Daniel BERNARDO
Forme juridique :	FCP
Politique de revenus :	Capitalisation et ou distribution
Devise :	EUR
Date de création :	15/05/1986
Horizon de placement :	Inférieur à 3 mois
Valorisation :	Quotidienne trésorerie
Limite de souscription :	J à 11h30
Limite de rachat :	J à 11h30
Règlement :	J
Commission de souscription :	Néant
Commission de rachat :	Néant
Frais de gestion et autres frais administratifs et d'exploitation :	0,06%
Dépositaire :	SOCIETE GENERALE PARIS
Valorisateur :	SOCIETE GENERALE PARIS

Evolution de la performance sur 1 an glissant



Source : Europerformance

Profil de risque

Niveau : **1** 2 3 4 5 6 7

Performance sur le mois



Source : Europerformance

Performance depuis le début de l'année



Source : Europerformance

Performances & Volatilités

	10 ans glissants		3 ans glissants		2 ans glissants		1 an glissant		Année 2024		6 mois	3 mois
	Perf.	Volat.	Perf.	Volat.	Perf.	Volat.	Perf.	Volat.	Perf.	Volat.	Perf.	Perf.
Ofi Invest ESG Liquidités C/D	2,95%	0,19%	3,80%	0,27%	4,33%	0,25%	3,74%	0,09%	0,72%	-	2,03%	1,02%
Indice de référence ⁽¹⁾	1,77%	0,17%	3,60%	0,26%	4,15%	0,24%	3,67%	0,06%	0,69%	-	2,00%	1,00%

Source : Europerformance

Performances mensuelles

	Jan.	Fév.	Mars	Avr.	Mai	Juin	Juillet	Août	Sept.	Oct.	Nov.	Déc.	Année	Indice
2019	-0,02%	0,01%	0,00%	0,00%	-0,02%	-0,01%	-0,01%	-0,02%	-0,02%	-0,02%	-0,03%	-0,02%	-0,16%	-0,35%
2020	-0,02%	-0,03%	-0,41%	-0,01%	0,02%	0,11%	0,07%	0,01%	0,03%	0,01%	-0,02%	-0,03%	-0,26%	-0,42%
2021	-0,03%	-0,03%	-0,04%	-0,04%	-0,04%	-0,04%	-0,03%	-0,05%	-0,04%	-0,04%	-0,06%	-0,03%	-0,46%	-0,52%
2022	-0,05%	-0,06%	-0,04%	-0,04%	-0,04%	-0,06%	-0,01%	0,04%	0,00%	0,07%	0,13%	0,13%	0,06%	0,02%
2023	0,19%	0,21%	0,21%	0,24%	0,30%	0,27%	0,32%	0,33%	0,30%	0,35%	0,34%	0,33%	3,41%	3,32%
2024	0,38%	0,33%											0,72%	0,69%

Source : Europerformance

(1) Indice de référence : EONIA Capitalisé + 5bps puis ESTER Capitalisé + 5bps depuis le 01/01/2021

Document d'information non contractuel. Le présent document ne s'adresse qu'aux porteurs de parts ou actions du présent OPC. Les informations contenues dans ce document ne sauraient avoir une quelconque valeur contractuelle. Seuls le prospectus complet de l'OPC et ses derniers états financiers font foi. Les performances passées ne préjugent en rien des résultats futurs et ne sont pas constantes dans le temps. Les performances présentées incluent l'ensemble des frais hors commission de souscription et rachat. L'investissement dans l'OPC présente des risques liés à la variation de la valeur des parts ou actions de l'OPC dues aux fluctuations du marché, les investissements réalisés pouvant donc varier tant à la hausse qu'à la baisse et les souscripteurs de l'OPC pouvant par conséquent perdre tout ou partie de leur capital initialement investi. Ce document n'a aucun caractère contractuel et ne fournit des informations qu'à titre indicatif. Le souscripteur reconnaît avoir reçu le prospectus communiqué à l'AMF préalablement à son investissement. La société de gestion ne garantit pas que les informations contenues dans ce document sont exactes, complètes et à jour malgré le soin apporté à sa préparation. Aucune responsabilité ne pourra être encourue du fait de pertes subies par les souscripteurs ayant fondé leur décision d'investissement sur ce seul document. Aucune reproduction, partielle ou totale, des informations contenues dans ce document n'est autorisée sans l'accord préalable de son auteur. Pour tout renseignement complémentaire relatif à l'OPC, le souscripteur pourra s'adresser à Ofi Invest Asset Management (22, rue Vernier 75017 Paris).

CONTACT • Département commercial • 01 40 68 17 17 • service.client@ofi-invest.com

Ofi Invest Asset Management • société de gestion de portefeuille S.A. à Conseil d'Administration au capital de 71 957 490 euros • RCS Paris 384 940 342 • APE 6630 Z • Agrément AMF n° GP 92-12 •

FR 51384940342

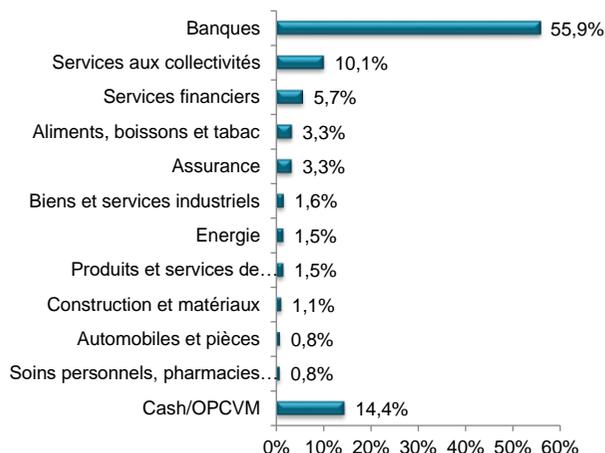
22, rue Vernier 75017 Paris • France • Tél. : +33 (0)1 40 68 17 17 • www.ofi-invest-am.com

Ofi Invest ESG Liquidités C/D

Reporting Mensuel - Monétaire - février 2024

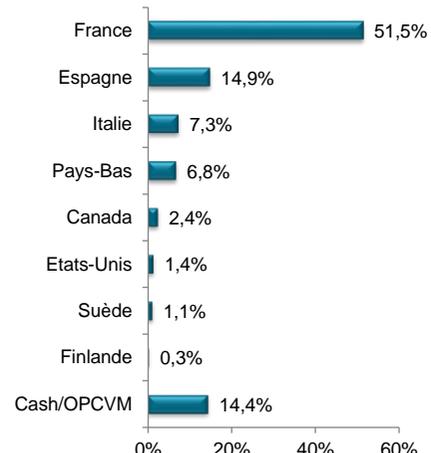


Répartition sectorielle ⁽¹⁾



Source : Ofi Invests AM

Répartition géographique



Source : Ofi Invest AM

Commentaire de gestion

Le portefeuille d'OFI INVEST ESG LIQUIDITES est principalement constitué de NeuCP, ECP, BTF... à hauteur de 88.6% de l'actif net soit environ 4 668 millions d'euros avec une maturité égale à 194 jours. Parallèlement la partie longue du portefeuille (FRN et NEU MTN) est à 0.4% soit 21 millions avec une maturité proche de 47 jours.

La durée de vie moyenne du portefeuille se situe à 168 jours.

Le poids des échéances comprises entre 1 et 30 jours est de 29.3%. Le secteur le plus représenté est le secteur bancaire à hauteur de 56% de l'actif net et ensuite les utilities à 10.1%.

Le taux de couverture ISR du fonds est de 99%.

Premier critère ISR : Présence des femmes au Board, taux de couverture de 93.5% et un indice de 42.48 pour un univers à 36.94

Deuxième critère ISR : Emissions financées, taux de couverture de 95.9% et un indice à 21.2 pour un univers à 87.44

(indice inversé en valeur).

L'exposition aux périphériques est de 21%

Le portefeuille d'OFI INVEST ESG LIQUIDITES tourne actuellement à des niveaux de Ester +22 bp. (marge actuarielle).

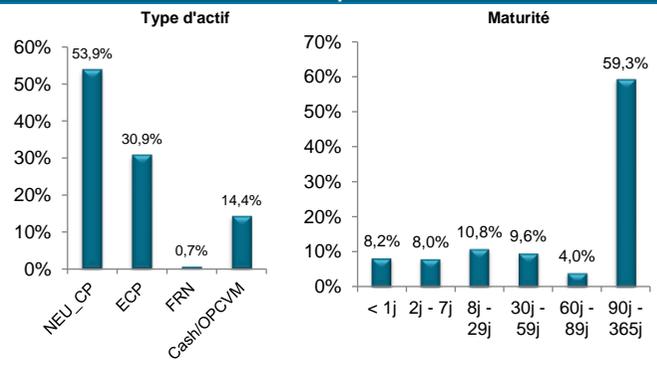
L'actif net du fonds s'établit à la fin du mois à **5 271 millions d'euros**.

OFI INVEST ESG LIQUIDITES réalise depuis le début de l'année une performance annualisée de +4.10% contre +3.92% pour l'Ester capitalisé **soit Ester +18 bp et il se classe 29ème sur 63 fonds** de la catégorie Monétaire Zone Euro source Europerformance.

Sur le mois, le fonds réalise une performance annualisée de +4.13% soit Ester+22 bp. Pour rappel, **OFI INVEST ESG LIQUIDITES se classe 10ème sur 55 fonds sur 3 ans.**

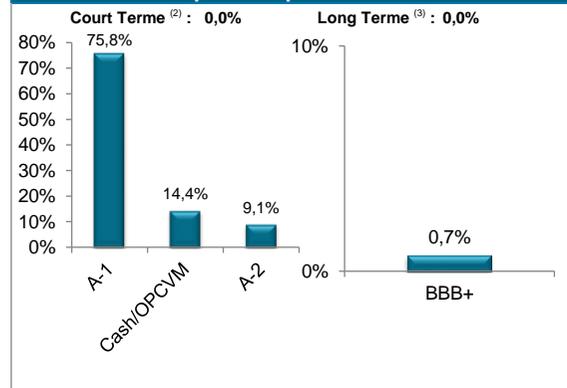
Emir HADZIC - Daniel BERNARDO - Gérant(s)

Structure du portefeuille



Source : Ofi Invest AM

Répartition par notation ⁽⁴⁾



Source : Ofi Invest AM

Principaux émetteurs

Libellé	Poids
CONFEDERATION NATIONALE DU CRE	9,07%
BPCE GROUPE	8,76%
CREDIT AGRICOLE GROUPE	8,40%
BNP PARIBAS	7,54%
SANTANDER CONSUMER FINANCE	4,16%
LA BANQUE POSTALE	3,59%
INTESA SAN PAOLO	3,56%
CAIXABANK	3,45%
BBVA (BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARI)	2,93%
TENNET	2,87%
TOTAL	54,32%

Source : Ofi Invest AM

(1) Classification ICB : FTSE/STOXX Industry Classification Benchmark

(2) Court Terme : maturité à l'achat inférieure à 1 an

(3) Long Terme : maturité à l'achat supérieure à 1 an

(4) Notations minimales : Haute qualité de crédit (analyse interne, cf. Directive "CRA")

Document d'information non contractuel. Le présent document ne s'adresse qu'aux porteurs de parts ou actions du présent OPC. Les informations contenues dans ce document ne sauraient avoir une quelconque valeur contractuelle. Seuls le prospectus complet de l'OPC et ses derniers états financiers font foi. Les performances passées ne préjugent en rien des résultats futurs et ne sont pas constantes dans le temps. Les performances présentées incluent l'ensemble des frais hors commission de souscription et rachat. L'investissement dans l'OPC présente des risques liés à la variation de la valeur des parts ou actions de l'OPC dues aux fluctuations du marché, les investissements réalisés pouvant donc varier tant à la hausse qu'à la baisse et les souscripteurs de l'OPC pouvant par conséquent perdre tout ou partie de leur capital initialement investi. Ce document n'a aucun caractère contractuel et ne fournit des informations qu'à titre indicatif. Le souscripteur reconnaît avoir reçu le prospectus communiqué à l'AMF préalablement à son investissement. La société de gestion ne garantit pas que les informations contenues dans ce document sont exactes, complètes et à jour malgré le soin apporté à sa préparation. Aucune responsabilité ne pourra être encourue du fait de pertes subies par les souscripteurs ayant fondé leur décision d'investissement sur ce seul document. Aucune reproduction, partielle ou totale, des informations contenues dans ce document n'est autorisée sans l'accord préalable de son auteur. Pour tout renseignement complémentaire relatif à l'OPC, le souscripteur pourra s'adresser à Ofi Invest Asset Management (22, rue Vernier 75017 Paris).

CONTACT • Département commercial • 01 40 68 17 17 • service.client@ofi-invest.com

Ofi Invest Asset Management • société de gestion de portefeuille S.A. à Conseil d'Administration au capital de 71 957 490 euros • RCS Paris 384 940 342 • APE 6630 Z • Agrément AMF n° GP 92-12 • FR 51384940342

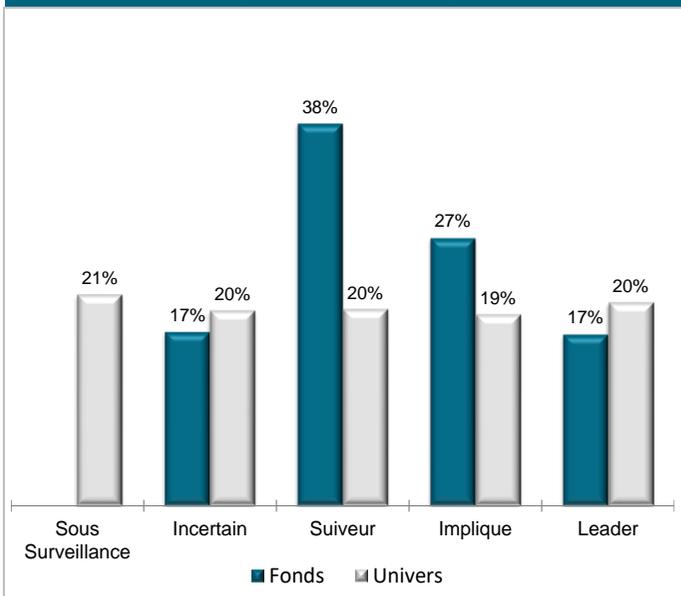
22, rue Vernier 75017 Paris • France • Tél. : +33 (0)1 40 68 17 17 • www.ofi-invest-am.com

Ofi Invest ESG Liquidités C/D

Reporting ISR Mensuel - février 2024

Répartition par catégorie ISR*

(Partie couverte rebasée)



Taux de couverture du fonds (1) : 99.23%

Taux de couverture de l'univers : 100%

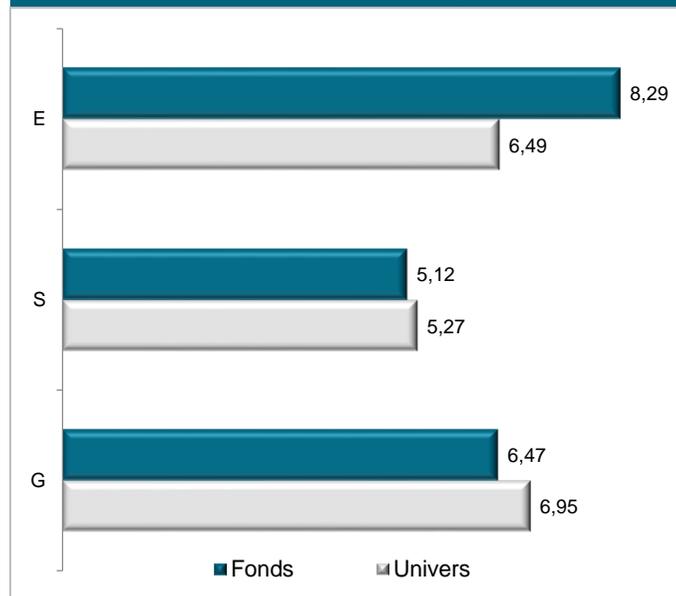
Répartition par catégorie ISR : la méthodologie ISR d'OFI réalise l'analyse extra-financière des émetteurs privés en fonction des enjeux clés de chaque secteur puis compare les entreprises entre elles afin de les classer en 5 catégories.

(1) Hors Disponibilité

Univers : Categ ISR MONETAIRE

Notations des domaines ESG*

(Partie couverte rebasée)



Taux de couverture du fonds (2) : 97.79%

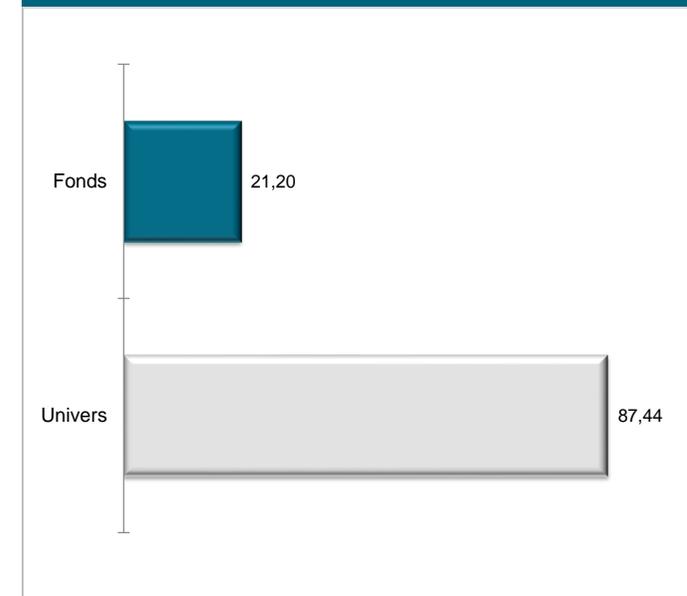
Taux de couverture de l'univers : 88.84%

ESG : Environnement, Sociétal et de Gouvernance

(2) Hors Disponibilité et OPCVM

Emissions financées (Teq CO2/m€)

(Partie couverte rebasée)



Taux de couverture du fonds (2) : 95.47%

Taux de couverture de l'univers : 93.8%

Emissions financées : émissions produites indirectement par un investisseur par les entreprises qu'il finance. Elles sont calculées de la façon suivante : Encours détenu x Total des émissions carbone de la société / Total du passif de la société (m€). Elles sont exprimées en tonnes équivalent CO2 par million d'euro investi.

Des informations complémentaires sur notre démarche ISR figurent sur notre site internet : www.ofi-am.fr/isr.

Document d'information non contractuel. Le présent document ne s'adresse qu'aux porteurs de parts ou actions du présent OPC. Les informations contenues dans ce document ne sauraient avoir une quelconque valeur contractuelle. Seuls le prospectus complet de l'OPC et ses derniers états financiers font foi. Les performances passées ne préjugent en rien des résultats futurs et ne sont pas constantes dans le temps. Les performances présentées incluent l'ensemble des frais hors commission de souscription et rachat. L'investissement dans l'OPC présente des risques liés à la variation de la valeur des parts ou actions de l'OPC dues aux fluctuations du marché, les investissements réalisés pouvant donc varier tant à la hausse qu'à la baisse et les souscripteurs de l'OPC pouvant par conséquent perdre tout ou partie de leur capital initialement investi. Ce document n'a aucun caractère contractuel et ne fournit des informations qu'à titre indicatif. Le souscripteur reconnaît avoir reçu le prospectus communiqué à l'AMF préalablement à son investissement. La société de gestion ne garantit pas que les informations contenues dans ce document sont exactes, complètes et à jour malgré le soin apporté à sa préparation. Aucune responsabilité ne pourra être encourue du fait de pertes subies par les souscripteurs ayant fondé leur décision d'investissement sur ce seul document. Aucune reproduction, partielle ou totale, des informations contenues dans ce document n'est autorisée sans l'accord préalable de son auteur. Pour tout renseignement complémentaire relatif à l'OPC, le souscripteur pourra s'adresser à Ofi Invest Asset Management (22, rue Vernier 75017 Paris).

CONTACT • Département commercial • 01 40 68 17 17 • service.client@ofi-invest.com

Ofi Invest Asset Management • société de gestion de portefeuille S.A. à Conseil d'Administration au capital de 71 957 490 euros • RCS Paris 384 940 342 • APE 6630 Z • Agrément AMF n° GP 92-12 • FR

51384940342

22, rue Vernier 75017 Paris • France • Tél. : +33 (0)1 40 68 17 17 • www.ofi-invest-am.com