

Ofi Invest ESG Monétaire

Reporting Mensuel - Monétaire - août 2023



L'objectif du fonds est de procurer au souscripteur un rendement court terme supérieur à l'ESTER Capitalisé + 5bps. La sélection des émetteurs est notamment réalisée selon un processus responsable. Le fonds s'adresse aux investisseurs institutionnels qui souhaitent obtenir un surcroît de rémunération de leur trésorerie par rapport au taux au jour-le-jour, en alliant souplesse d'utilisation et recherche d'un risque minimum. L'allongement de la maturité des investissements sera l'une des sources de surperformance.

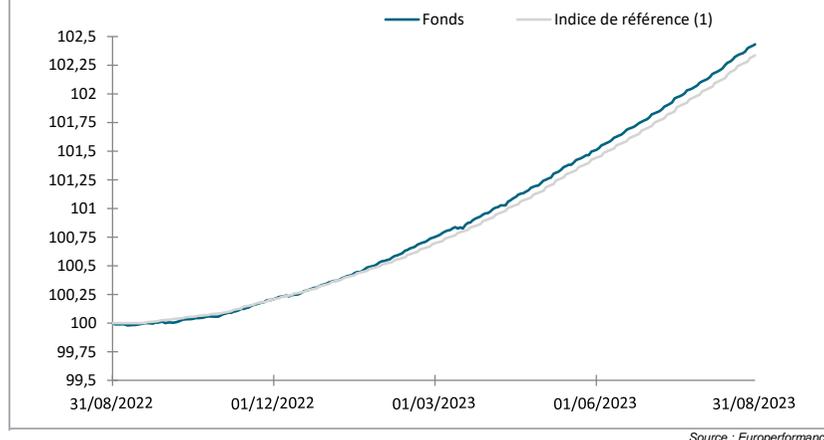
Chiffres clés au 31/08/2023

Valeur Liquidative (en euros) :	101 946,29
Actif net de la Part (en millions d'euros) :	5 053,61
Performance YTD annualisée :	ESTER +17 bps
WAM <183 j	7 jours
WAL <365 j	100 jours
Tracking error 10 ans :	0,09%

Caractéristiques du fonds

Code ISIN :	FR0011381227
Ticker :	MACIOFI FP Equity
Classification AMF :	Monétaire à valeur liquidative variable (VNAV) standard
Classification Europerformance :	Trésorerie
Classification SFDR :	Article 8
Indice de référence ⁽¹⁾ :	ESTER Capitalisé + 5bps
Principaux risques :	Risques de capital et performances Risques de marché : taux
Société de gestion :	OFI INVEST ASSET MANAGEMENT
Gérant(s) :	Daniel BERNARDO - Emir HADZIC
Politique de revenus :	Capitalisation
Devise :	EUR
Date de création :	16/11/2009
Horizon de placement :	6 à 12 mois
Valorisation :	Quotidienne
Frais de gestion et autres frais administratifs et d'exploitation :	0,05%
Dépôtairaire :	SOCIETE GENERALE PARIS

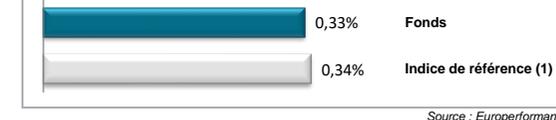
Evolution de la performance sur 1 an glissant



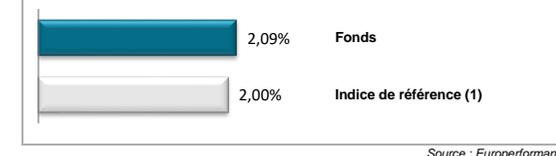
Profil de risque

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

Performance sur le mois



Performance depuis le début de l'année



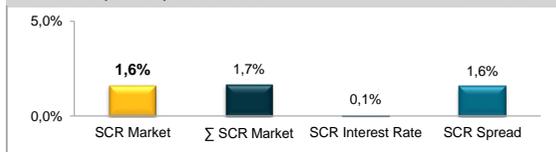
Performances & Volatilités

	10 ans glissants		3 ans glissants		2 ans glissants		1 an glissant		Année 2023		6 mois	3 mois
	Perf.	Volat.	Perf.	Volat.	Perf.	Volat.	Perf.	Volat.	Perf.	Volat.	Perf.	Perf.
Ofi invest ESG Monétaire	1,73%	0,15%	1,70%	0,21%	2,00%	0,23%	2,43%	0,16%	2,09%	0,08%	1,68%	0,92%
Indice de référence ⁽¹⁾	-0,17%	0,12%	1,34%	0,20%	1,84%	0,22%	2,34%	0,15%	2,00%	0,08%	1,63%	0,89%

Source : Europerformance

Solvency Capital Requirement

SCR Market (en EUR)* au 31/07/23 : **75 503 082**



Performances mensuelles

	Jan.	Fév.	Mars	Avr.	Mai	Juin	Juillet	Août	Sept.	Oct.	Nov.	Déc.	Année	Indice
2018	-0,01%	-0,02%	-0,03%	-0,02%	-0,07%	-0,02%	0,00%	-0,02%	0,00%	-0,02%	-0,02%	-0,02%	-0,25%	-0,32%
2019	-0,01%	0,01%	0,00%	0,00%	-0,02%	-0,01%	0,00%	-0,01%	-0,02%	-0,01%	-0,02%	-0,02%	-0,12%	-0,35%
2020	-0,02%	-0,03%	-0,48%	0,00%	0,05%	0,11%	0,08%	0,01%	0,03%	0,01%	-0,02%	-0,02%	-0,28%	-0,42%
2021	-0,03%	-0,03%	-0,04%	-0,04%	-0,04%	-0,04%	-0,03%	-0,05%	-0,04%	-0,04%	-0,05%	-0,03%	-0,46%	-0,52%
2022	-0,05%	-0,06%	-0,04%	-0,04%	-0,05%	-0,09%	-0,01%	0,07%	0,00%	0,06%	0,13%	0,13%	0,07%	0,02%
2023	0,20%	0,20%	0,21%	0,22%	0,30%	0,27%	0,31%	0,33%					2,09%	2,00%

Source : Europerformance

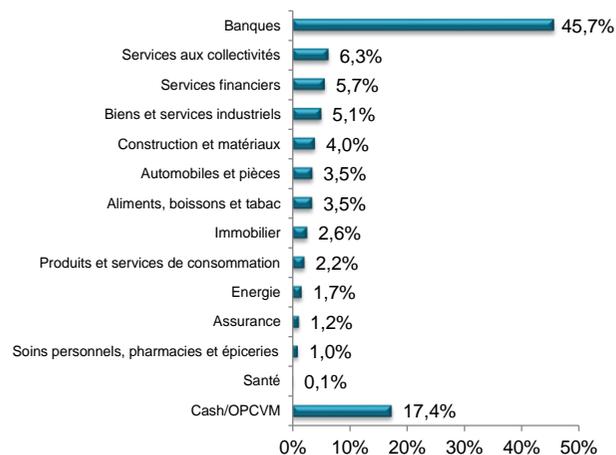
(1) Indice de référence : EONIA Capitalisé + 5bps puis ESTER Capitalisé + 5bps depuis le 01/01/2021

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

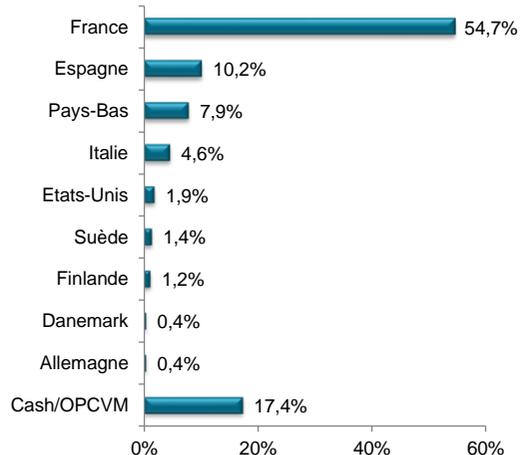
Ofi Invest Asset Management • société de gestion de portefeuille S.A. à Conseil d'Administration au capital de 71 957 490 euros • RCS Paris 384 940 342 • APE 6630 Z • Agrément AMF n° GP 92-12 • FR 51384940342
22, rue Vernier 75017 Paris • France • Tél. : +33 (0)1 40 68 17 17 • www.ofi-invest-am.com

Répartition sectorielle ⁽¹⁾



Source : Ofi Invest AM

Répartition géographique



Source : Ofi Invest AM

Commentaire de gestion

Le portefeuille d'OFI INVEST ESG MONETAIRE est principalement constitué de NeuCP, ECP, BTF à hauteur de 89.2% de l'actif net soit environ 4 508 millions d'euros avec une maturité égale à 119 jours. Parallèlement la partie longue du portefeuille (FRN et NEU MTN) est à 2.6 % soit 131 millions d'euros avec une maturité proche de 102 jours. La durée de vie moyenne du portefeuille se situe à 100 jours. Le poids des échéances comprises entre 1 et 30 jours est de 29.4%. Le secteur le plus représenté est le secteur bancaire à hauteur de 45.7% de l'actif net et ensuite le secteur des utilities à 6.3%. L'exposition aux périphériques est de 14.8%. Le taux de couverture ISR du fonds est de 99.77%. Premier critère ISR : Présence des femmes au Board, taux de couverture de 95.9% et un indice de 41.54 pour un univers à 36.62. Deuxième critère ISR : Emissions financées, taux de couverture de 96.31% et un indice à 29.37 pour un univers à 88.16 (indice inversé en valeur).

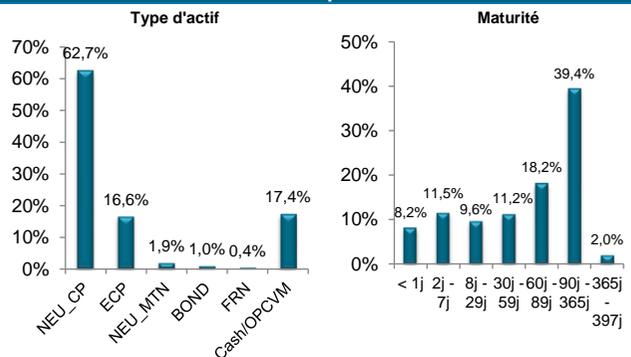
Le portefeuille d'OFI INVEST ESG MONETAIRE tourne actuellement à des niveaux de Ester +17 bp. (marge actuarielle).

L'actif net du fonds s'établit à la fin du mois à **5 054 millions d'euros**.

OFI INVEST ESG MONETAIRE réalise depuis le début de l'année une performance annualisée de +3.07% contre +2.90% pour l'Ester capitalisé **soit Ester +17 bp et il se classe 11ème sur 62 fonds** de la catégorie Monétaire Zone Euro source Europerformance. Sur le mois, le fonds réalise une performance annualisée de +3.82% soit Ester+18bp. Pour rappel, **OFI INVEST ESG MONETAIRE se classe 4ème sur 57 fonds sur 3 ans**.

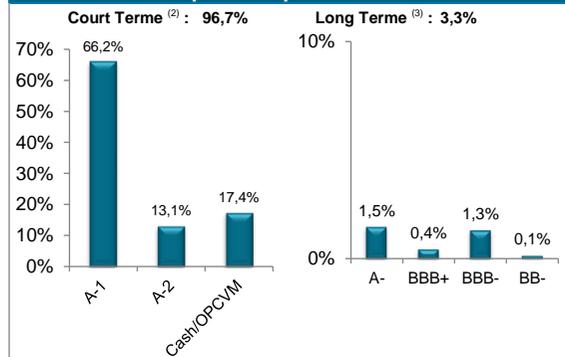
Daniel BERNARDO - Emir HADZIC - Gérant(s)

Structure du portefeuille



Source : Ofi Invest AM

Répartition par notation ⁽⁴⁾



Source : Ofi Invest AM

Principaux émetteurs

Libellé	Poids
CREDIT AGRICOLE GROUPE	8,32%
CONFEDERATION NATIONALE DU CRE	7,77%
BPCE GROUPE	7,47%
ING GROUPE	6,42%
LA BANQUE POSTALE	5,15%
BNP PARIBAS	3,77%
SANTANDER CONSUMER FINANCE	2,89%
BBVA (BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARI)	2,87%
VINCI	1,97%
INTESA SAN PAOLO	1,94%
TOTAL	48,56%

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).

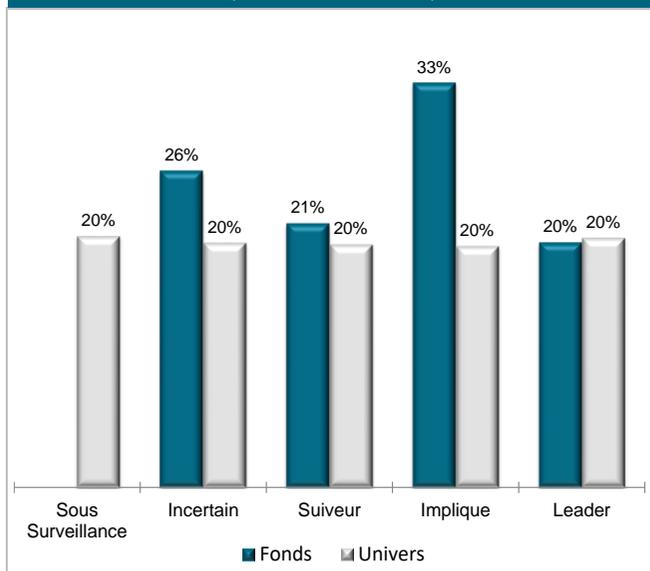
CONTACT • Département commercial • 01 40 68 17 17 • service.client@ofi-invest.com

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

Répartition par catégorie ISR*

(Partie couverte rebasée)



Taux de couverture du fonds (1) : 99.77%

Taux de couverture de l'univers : 100%

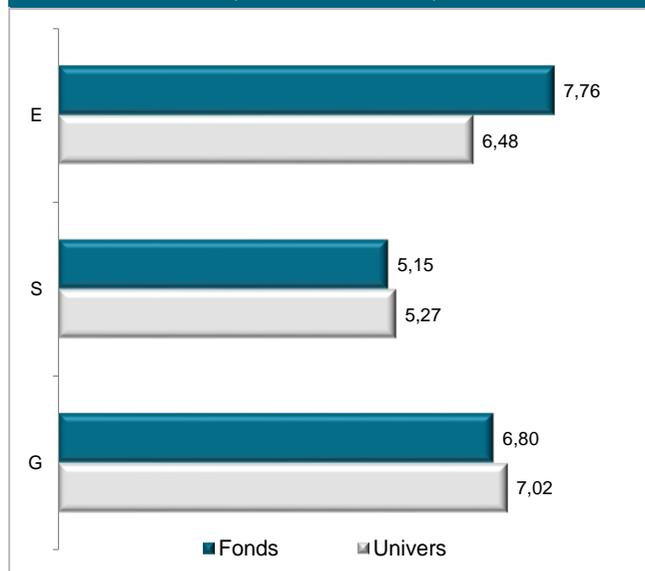
Répartition par catégorie ISR : la méthodologie ISR d'OFI réalise l'analyse extra-financière des émetteurs privés en fonction des enjeux clés de chaque secteur puis compare les entreprises entre elles afin de les classer en 5 catégories.

(1) Hors Disponibilité

Univers : Categ ISR MONETAIRE

Notations des domaines ESG*

(Partie couverte rebasée)



Taux de couverture du fonds (2) : 99.37%

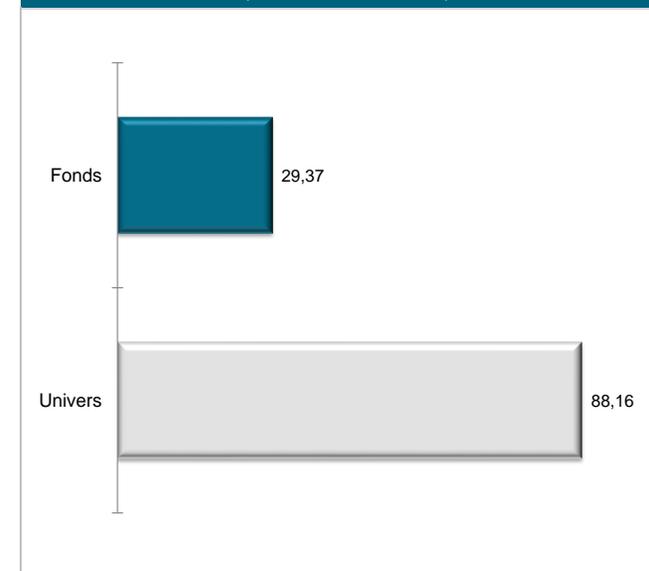
Taux de couverture de l'univers : 88.34%

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) : 96.31%

Taux de couverture de l'univers : 94.61%

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