Oaks Field Partners

OFP 150 – Part C

30 novembre 2017

Caractéristiques du fonds

Création	5 juin 2008	
Forme juridique	Fonds Commun de Placement	
Passeport	Ucits IV	
Domicile	France	
Classification	Obligations et autres titres de créance internationales (classification AMF)	
Liquidité	Journalière (avant 11h30)	
Actif du fonds	21228956	(30/11/2017)
Actif de la part	1 599 757 €	(30/11/2017)
Valeur de la part	101,92 €	(30/11/2017)
ISIN	FR0010627281	
Bloomberg	AFVOFPC FP	
Devise	EUR	
Stratégie	Performance Absolue	
Référence	Eonia Capitalisé	
Objectif	Eonia Capitalisé + 1.5 %	
Nouvelle souscription	Part ouverte	
Politique de distribution	Capitalisation	
Frais de gestion fixes	1.25%	
Commission de performance	15%*	
Commission de souscription	2% maximum	
Commission de rachat	0%	

*15% de la différence dès lors que la performance du fonds excède l'indice Eonia capitalisé +1.5%

Auditeur	PwC Sellam
Valorisateur	CACEIS Fund Administration
Dépositaire	RBC Investor Services Bank

Source: Oaks Field Partners

Profil de risque

À risque + faible Rendement potentiellement plus faible

À risque + élevé Rendement potentiellement plus élevé

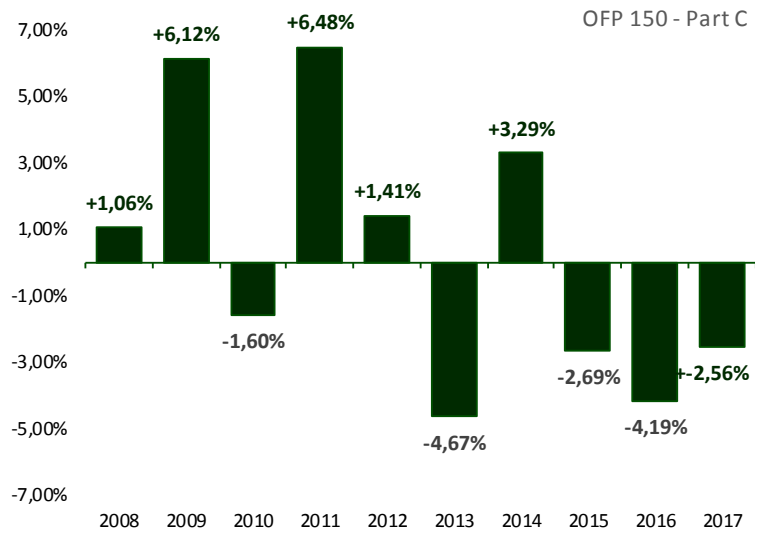
1	2	**3**	4	5	6	7

(définition de cet indicateur au verso)

Objectif du fonds & Univers d'investissement

OFP 150, de classification obligations et autres titres de créance internationaux, a pour objectif de générer une performance annualisée supérieure de 1.5% à celle de l'EONIA capitalisé. Les stratégies mises en œuvre porteront sur les taux d'intérêts, par la gestion active de la sensibilité du portefeuille (en titre ou par le biais de futures) comprise entre - 4 et + 4, des arbitrages sur la valeur relative entre les marchés de taux internationaux, des arbitrages sur les courbes de taux d'intérêts et sur les marchés de Crédit. D'autres stratégies concerneront les marchés de changes, par la mise en place d'une allocation stratégique, et la gestion de la volatilité (taux et devises) par l'achat ou la vente d'option sur les marchés réglementés.

Performance depuis création (Part C - nette de frais)



Source: Oaks Field Partners

Performance mensuelle (Part C – nette de frais)

150-C	Jan	Feb	Mar	Apr	May	Jun	Jul	Aug	Sep	Oct	Nov	Dec	Year
2008						-0,02%	0,89%	0,65%	1,22%	0,51%	-1,49%	-0,68%	**1,06%**
2009	1,33%	0,63%	0,05%	1,83%	0,30%	0,66%	0,48%	0,08%	0,21%	0,16%	0,17%	0,07%	**6,12%**
2010	0,35%	0,07%	0,12%	-0,33%	-0,89%	-0,68%	0,40%	0,76%	-0,09%	-1,58%	0,63%	-0,35%	**-1,60%**
2011	-0,44%	0,70%	-0,44%	-0,40%	1,57%	0,87%	1,22%	1,18%	1,37%	-0,42%	0,78%	0,33%	**6,48%**
2012	0,03%	0,93%	0,32%	-0,12%	-0,49%	1,20%	-0,81%	0,33%	0,20%	0,31%	-0,21%	-0,26%	**1,41%**
2013	-0,47%	0,71%	-0,10%	-1,24%	0,15%	0,68%	-0,92%	0,10%	-0,66%	-0,35%	-1,54%	-1,11%	**-4,67%**
2014	1,75%	-0,64%	-0,28%	0,15%	0,72%	-0,62%	0,34%	0,74%	-0,09%	0,58%	0,13%	0,49%	**3,29%**
2015	1,66%	-2,57%	-0,37%	-0,39%	-0,59%	0,22%	0,03%	0,85%	-0,32%	-1,15%	-1,16%	1,14%	**-2,69%**
2016	0,38%	0,91%	-0,04%	0,38%	-1,25%	2,16%	-0,30%	-0,65%	-0,51%	-0,53%	-3,56%	-1,16%	**-4,19%**
2017	1,45%	-0,84%	-0,10%	0,14%	0,35%	1,50%	0,16%	-0,14%	-1,42%	-2,49%	-1,15%		**-2,56%**

Comparatif du fonds (Part C – nette de frais)

	OFP 150 C	Eonia	Difference
2008	1,06%	2,19%	-1,13%
2009	6,12%	0,73%	5,38%
2010	-1,60%	0,44%	-2,04%
2011	6,48%	0,89%	5,60%
2012	1,41%	0,24%	1,17%
2013	-4,67%	0,09%	-4,76%
2014	3,29%	0,10%	3,19%
2015	-2,69%	-0,11%	-2,58%
2016	-4,19%	-0,32%	-3,86%
2017	-2,56%	-0,33%	-2,23%

Source: Oaks Field Partners

Statistiques (Part C – nette de frais)

	Ytd	3M	6M	1Y	Inception
Performance	-2,56%	-4,98%	-3,53%	-3,69%	0,20%
Volatilité	4,03%	3,96%	3,91%	4,24%	3,01%
Sharpe	-0,55	-1,23	-0,86	-0,79	-0,07

% mois positif (depuis création)	55,3%
% mois negatif (depuis création)	44,7%

Source: Oaks Field Partners

Ce document, à caractère non contractuel, a pour but de vous informer de manière simplifiée sur les caractéristiques du fonds.
Pour plus d'informations, veuillez vous référer au DICI & prospectus du fonds disponibles sur le site internet www.oaksfieldpartners.com

Oaks Field Partners

OFP 150 – Part C

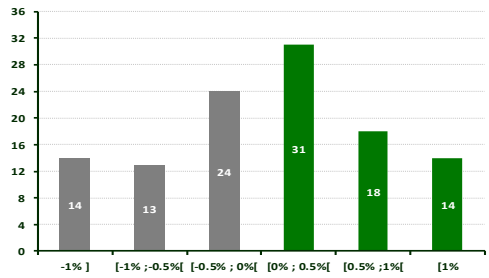
30 novembre 2017

Attribution de la performance (Part C - nette de frais)

	1M	6M	1Y
Duration	0,02%	-0,47%	-2,88%
Courbe de taux	-0,99%	-0,75%	-1,37%

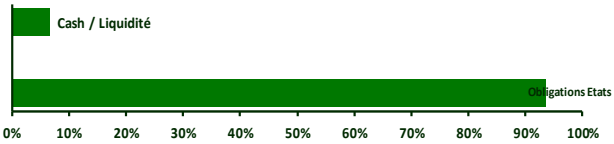
Source: Oaks Field Partners

Distribution performance mensuelle (Part C - nette de frais)



Exposition du portefeuille

Source: Oaks Field Partners



Futures (Gross Exposure*)

Fixed Income	406%
Currencies	19%
(x AuM)	***425,00%***

**Sum of all positions in absolute term*

Fund's modified Duration	**0,24**

Futures - Currencies

	Long	Short
EUR	8,17%	
USD		-8,02%
JPY		-2,71%
GBP	0,45%	
Others	2,15%	

Duration (Securities & Futures)

EURO	Govies	Corporates
1Y <	0,08	0,00
2Y <	0,02	0,00
5Y <	-3,73	0,00
10Y <	-2,32	0,00
10Y +	-5,69	0,00

Duration (Securities & Futures)

USD & CAD	Govies	Corporates
1Y <	0,00	0,00
2Y <	0,00	0,00
5Y <	1,68	0,00
10Y <	6,12	0,00
10Y +	4,08	0,00

Indicateur de risque

Cet indicateur permet de mesurer le potentiel de performance attendue et le risque auquel votre capital est exposé. Veuillez noter qu'une possibilité élevée de gain comporte aussi un risque élevé de perte. La catégorie la plus faible ne signifie pas «sans risque». Les données historiques, telles que celles utilisées pour calculer cet indicateur synthétique, pourraient ne pas constituer une indication fiable du profil de risque futur de l'OPCVM. La catégorie de risque associée à ce fonds n'est pas garantie et pourra évoluer dans le temps. Il est recommandé d'investir raisonnablement dans cet OPCVM en fonction de la situation personnelle de chaque investisseur, et de diversifier suffisamment ses investissements afin de ne pas les exposer uniquement aux risques de l'OPCVM. Ce fonds est classé dans cette catégorie car elle reflète les prises de position à l'achat et à la vente de la gestion sur les marchés de taux internationaux. Les risques importants pour l'OPCVM sont : risque de change, risque lié à la surexposition, risque de taux, risque lié au crédit, risque lié aux arbitrages.

Définitions

La performance, souvent exprimée en pourcentage, permet de mesurer le gain ou la perte en capital d'un placement sur une période (10% = gain de 10 pour 100 investis). La performance peut aussi s'exprimer annualisée. Elle revient à rapporter sur une période d'un an la performance d'un fonds issue d'une période quelconque. Dans les deux cas, une perte se traduira par un pourcentage négatif et un gain pour un pourcentage positif.

La volatilité d'un titre se traduit par l'écart des performances à leur moyenne et permet donc d'apprécier la régularité avec laquelle ces performances ont été obtenues. Elle constitue une mesure du risque. Si elle est nulle, cela veut dire que les performances unitaires sont identiques. Plus elle est forte, plus les performances unitaires sont différentes les unes des autres.

Le ratio de Sharpe se traduit par la surperformance du produit par rapport à un taux sans risque, ajustée par la volatilité du produit.

Avertissements et risques du produit

Les performances, classements, prix, notations, statistiques et données passées ne sont pas des indicateurs fiables des performances, classements, prix, notations, statistiques et données futures. Les données de performance ne tiennent pas compte des commissions et frais perçus lors de l'émission et du rachat des parts, et ne tiennent pas compte des frais fiscaux imposés par le pays de résidence du client. Ce document est exclusivement conçu à des fins d'information. Il ne saurait être assimilé à une activité de démarchage ou à une quelconque offre de valeur mobilière ou à un service de conseil en investissement. Il ne constitue pas un élément contractuel. Ce document est réalisé à partir des meilleures sources, cependant Oaks Field Partners ne peut en garantir ni l'exhaustivité ni la fiabilité. La responsabilité d'Oaks Field Partners ne saurait être engagée par une décision prise sur la base de ces informations. Le prospectus de l'OPCVM, agréé par l'AMF est disponible sur le site www.oaksfieldpartners.com ainsi qu'auprès de votre interlocuteur habituel sur simple demande. Tout investisseur potentiel doit se rapprocher de son prestataire ou conseiller, afin de se forger sa propre opinion sur les risques inhérents à chaque investissement et sur leur adéquation avec sa situation patrimoniale et personnelle. A cet effet, il devra prendre connaissance du DICI dans lequel figurent le descriptif et le détail des risques de l'OPCVM visé par l'Autorité des Marchés Financiers de l'OPCVM remis avant toute souscription et disponible sur le site www.oaksfieldpartners.com ou sur simple demande au siège social d'Oaks Field Partners. Conformément à l'article 314-76 du règlement général de l'AMF, le client peut recevoir sur demande de sa part, des précisions sur les rémunérations relatives à la commercialisation du présent produit.

Contact

+33 (0)1 85 08 13 75
info@oaksfieldpartners.com

Oaks Field Partners
Société de gestion de portefeuille – AMF agreement n° GP-12000016
Headquarter: 53 boulevard Beauséjour. 75016 Paris. France. Office: 152 Boulevard Haussmann. 75008 Paris. France.
SAS au Capital de 524 400 euros - RCS Paris 502702426
www.oaksfieldpartners.com