

Caractéristiques du fonds

Création	6 novembre 2011	
Forme juridique	Fonds Commun de Placement	
Passeport	Ucits IV	
Domicile	France	
Classification	Diversifié (classification AMF)	
Liquidité	Journalière (avant 11h30)	
Actif du fonds	24 590 234,22 €	(30/11/2017)
Actif de la part	\$1 826 158,80	(30/11/2017)
Valeur de la part	\$15 217,99	(30/11/2017)
ISIN	FR0011141324	
Bloomberg	AFIMOFU FP	
Devise	USD	

Stratégie	Performance Absolue
Référence	Eonia Capitalisé
Objectif	Eonia Capitalisé + 4.0 %

Nouvelle souscription	Part ouverte
Politique de distribution	Capitalisation
Frais de gestion fixes	1.30%
Commission de performance	20%*
Commission de souscription	2% maximum
Commission de rachat	0%

*20% de la différence dès lors que la performance du fonds excède l'indice Eonia capitalisé +4.0%

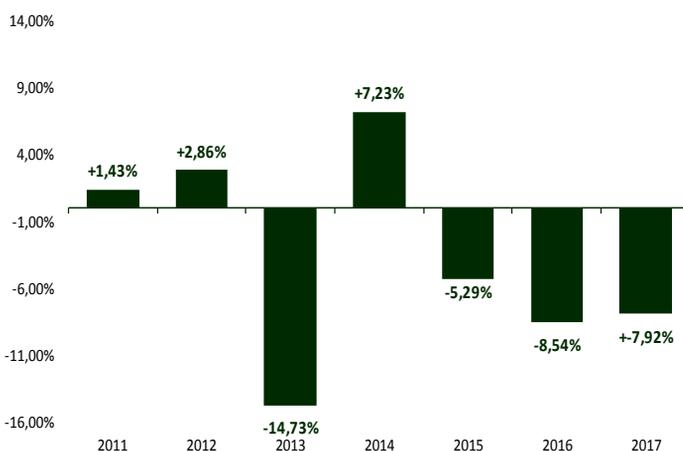
Auditeur	PwC SELLAM
Valorisateur	CACEIS Fund Administration
Dépositaire	RBC Investor Services Bank

Source: Oaks Field Partners

Profil de risque



OFP 400 - Part U



Source: Oaks Field Partners

Performance mensuelle (Part U – nette de frais)

	Jan	Feb	Mar	Apr	May	Jun	Jul	Aug	Sep	Oct	Nov	Dec	Year
2011											1,14%	0,29%	1,43%
2012	0,77%	1,32%	0,03%	0,03%	-1,45%	3,38%	-1,43%	0,63%	0,26%	0,93%	-0,44%	-1,12%	2,86%
2013	-1,22%	0,92%	-0,49%	-3,64%	-0,43%	3,79%	-2,97%	0,62%	-3,17%	-2,73%	-3,82%	-2,39%	-14,73%
2014	5,77%	-2,92%	-0,40%	0,70%	0,61%	-1,44%	0,91%	1,42%	-0,82%	1,62%	-0,22%	2,01%	7,23%
2015	4,06%	-7,46%	-0,50%	-1,61%	-1,31%	1,03%	-0,51%	3,51%	1,01%	-3,62%	-1,82%	2,36%	-5,29%
2016	3,72%	1,75%	-1,04%	0,75%	-2,09%	4,62%	-2,06%	-1,21%	-1,16%	-0,79%	-8,34%	-2,42%	-8,54%
2017	3,65%	-3,15%	0,02%	-0,22%	-0,13%	2,02%	-1,05%	0,78%	-3,37%	-4,83%	-1,64%		-7,92%

Comparatif du fonds (Part U – nette de frais)

	OFP 400 U	Eonia	Difference
2011	1,43%	0,10%	1,33%
2012	2,86%	0,24%	2,63%
2013	-14,73%	0,09%	-14,82%
2014	7,23%	0,10%	7,13%
2015	-5,29%	-0,11%	-5,18%
2016	-8,54%	-0,32%	-8,22%
2017	-7,92%	-0,33%	-7,59%

Source: Oaks Field Partners

Statistiques (Part U – nette de frais)

	Ytd	3M	6M	1Y	Annualised (inception)
Performance	-7,92%	-9,55%	-7,98%	-10,15%	-4,40%
Volatilité	9,29%	7,07%	7,38%	9,78%	8,76%
Sharpe	-0,82	-1,34	-1,06	-1,00	-0,50
	% mois positif (depuis création)			45,2%	
	% mois négatif (depuis création)			54,8%	
	Max Drawdown			-28,48%	

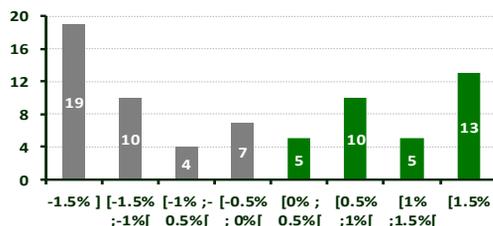
Source: Oaks Field Partners

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

OFP 400 - U	1M	6M	1Y
Duration	0,03%	0,27%	-4,03%
Courbe de taux	0,12%	0,67%	-0,52%
Ecart Pays	-0,58%	0,57%	-0,49%

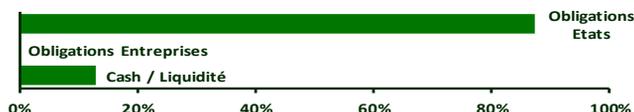
Source: Oaks Field Partners

Distribution performance mensuelle (Part U - nette de frais)



Source: Oaks Field Partners

Exposition du portefeuille



Futures (Gross Exposure*)	
Fixed Income	493%
Equities	51%
Currencies	34%
Commodities	0%

Source: Oaks Field Partners

(x AuM) 578,00%

*Sum of all positions in absolute term

Fund's modified Duration 0,48

Duration (Securities & Futures)			
	EURO	Govies	Corporates
1Y <	0,00	0,00	0,00
2Y <	-0,06	0,00	0,00
5Y <	-5,29	0,00	0,00
10Y <	-4,01	0,00	0,00
10Y +	-6,01	0,00	0,00

Duration (Securities & Futures)			
	USD & CAD	Govies	Corporates
1Y <	0,00	0,00	0,00
2Y <	0,00	0,00	0,00
5Y <	0,01	0,00	0,00
10Y <	0,00	0,00	0,00
10Y +	10,30	0,00	0,00

Futures - Equities	
Long	Short
Other Europe	-1,98%
SP500	-29,5%
Russell 2000	-4,9%
NASDAQ	-5,1%
Topix	-9,2%
Total	-50,7%

Futures - Currencies	
Long	Short
EUR	14,70%
USD	-15,20%
JPY	-2,40%
GBP	0,50%
Others	2,43%

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.

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

Contact

+33 (0)1 85 08 13 75

info@oaksfieldpartners.com