

OFI RS PRUDENT R

Reporting Mensuel - Diversifiés - août 2021



OFI RS Prudent est un fonds diversifié flexible intervenant sur les marchés obligataires, monétaires et actions de la zone euro. Le fonds est essentiellement investi sur les supports obligataires, son exposition aux actions étant comprise entre 0 et 30%. En complément de l'analyse fondamentale des titres sélectionnés, l'équipe de gestion met en œuvre une analyse de critères extra financiers afin de privilégier une sélection « Investissement Socialement Responsable » (ISR) des sociétés en portefeuille. Cette étude est réalisée en prenant en compte des éléments Environnementaux, Sociétaux et de Gouvernance.

Chiffres clés au 31/08/2021

Valeur Liquidative (en euros) :	104,34
Actif net (en millions d'euros) :	1,33
Actif net Total des parts (en millions d'euros) :	187,15
Nombre de lignes :	202
Exposition actions (en engagement) :	16,86%
Sensibilité (2) Taux :	1,66
Sensibilité (2) Crédit :	2,27

Caractéristiques du fonds

Code ISIN :	FR0013247418
Ticker :	OFRSRCE FP Equity
Classification AMF :	Fonds mixte
Classification Europerformance :	Diversifié euro - dominante taux
Indice de référence (1) :	Indice Composite OFI RS PRUDENT

Principaux risques : Risque de perte en capital - Risque inhérent à la gestion discrétionnaire - Risque de marchés : actions, taux d'intérêt, liquidité, crédit, contrepartie - Risque de modèle

Société de gestion : OFI ASSET MANAGEMENT

Gérant(s) : M HABETS - J.P PORTA

Forme juridique : FCP

Affectation du résultat : Capitalisation

Devise : EUR

Date de création : 03/05/2017

Horizon de placement : 2 ans

Valorisation : Quotidienne

Limite de souscriptions : J à 10h

Limite de rachats : J à 10h

Règlement : J + 2

Commission de souscription : Néant

Commission de rachats : Néant

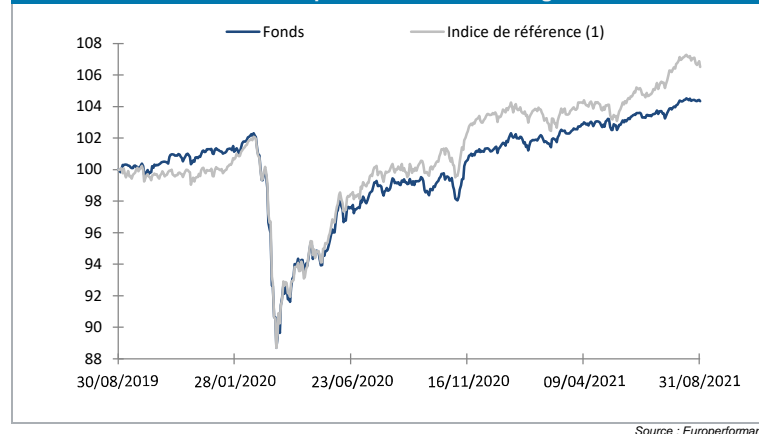
Commission de surperformance : Néant

Frais courants : 1,34%

Dépositaire : SOCIETE GENERALE PARIS

Valorisateur : SOCIETE GENERALE SECURITIES SERVICES

Evolution de la performance sur 2 ans glissants



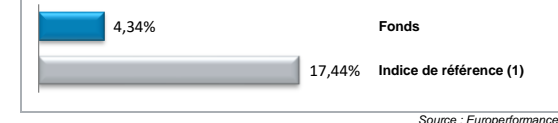
Profil de risque

Niveau : 1 2 3 4 5 6 7

Performance sur le mois



Performance depuis création



Performances & Volatilités

	Depuis création		5 ans glissants		3 ans glissants		1 an glissant		Année 2021		6 mois	3 mois
	Perf.	Volat.	Perf.	Volat.	Perf.	Volat.	Perf.	Volat.	Perf.	Volat.	Perf.	Perf.
OFI RS PRUDENT R	4,34%	5,01%	-	-	4,80%	5,85%	5,32%	3,28%	2,79%	2,28%	2,88%	1,24%
Indice de référence (1)	17,44%	5,15%	-	-	16,27%	5,90%	7,04%	3,77%	2,79%	3,13%	3,97%	2,20%

Source : Europerformance

Performances mensuelles

	Jan.	Fév.	Mars	Avr.	Mai	Juin	Juillet	Août	Sept.	Oct.	Nov.	Déc.	Année	Indice
2017					0,03%	-0,27%	0,58%	0,26%	0,46%	0,94%	-0,25%	-0,32%	1,43%	1,21%
2018	0,29%	-0,61%	-0,20%	0,54%	-1,91%	0,33%	0,56%	-0,83%	0,08%	-1,48%	-0,40%	-0,72%	-4,29%	-0,97%
2019	0,80%	0,81%	0,42%	1,18%	-1,40%	1,36%	0,50%	-0,67%	0,38%	0,00%	0,42%	0,18%	4,02%	9,52%
2020	0,01%	-1,63%	-6,78%	2,81%	0,86%	1,64%	0,78%	0,73%	-0,38%	-0,66%	3,13%	0,40%	0,52%	4,07%
2021	-0,30%	0,21%	1,12%	0,14%	0,35%	0,32%	0,55%	0,37%					2,79%	2,79%

Source : Europerformance

*Performance du 03/05/2017 au 31/05/2017

(1) Indice de référence : 10 % Euro Stoxx Net Return / 60 % FTSE MTS EMU Gov Bond Index / 30 % Markit iBoxx Euro Liquid Corporates Overall puis 10 % Euro Stoxx Net Return / 60 % BofA Merrill Lynch Euro Government Index / 30 % Markit iBoxx Euro Liquid Corporates Overall puis 20 % Euro Stoxx Net Return / 53 % BofA Merrill Lynch Euro Government Index / 27 % Markit iBoxx Euro Liquid Corporates Overall à partir du 02/04/2019

(2) La sensibilité mesure la variation d'une valeur en pourcentage induite par une variation donnée du sous-jacent. Exemple pour une obligation de sensibilité -1, si le taux d'intérêt augmente de 1%, la valeur de l'obligation diminue d'1%.

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 Asset Management (22, rue Vernier 75017 Paris).

CONTACT • Département commercial • 01 40 68 17 17 • contact@ofi-am.fr

OFI Asset Management • Société de gestion de portefeuille agréée par l'AMF sous le numéro GP 92-12 • N° de TVA intra-communautaire : FR 51384940342 •

S.A à Conseil d'Administration au capital de 42 000 000 Euros • APE 6630Z2 rue Vernier 75017 Paris •

Tél. : + 33 (0)1 40 68 17 17 • Fax : + 33 (0)1 40 68 17 18 • www.ofi-am.fr



OFI RS PRUDENT R

Reporting Mensuel - Diversifiés - août 2021



PRINCIPALES LIGNES (HORS MONÉTAIRE)

Libellé	Poids	Performances	Contributions	Classe d'actif	Pays
ASML	1,44%	10,25%	0,13%	Actions	Pays-Bas
SAP	1,02%	5,48%	0,05%	Actions	Allemagne
L OREAL	0,77%	2,69%	0,02%	Actions	France
ENEL	0,77%	-0,81%	-0,01%	Actions	Italie
TELEPERFORMANCE	0,66%	5,29%	0,03%	Actions	France
CA 2.625 2027_03	0,65%	-0,11%	0,00%	Obligations	France
MUNICH RE 1.000 2042_05	0,63%	Entrée	Entrée	Obligations	Allemagne
CRH PLC	0,63%	6,60%	0,04%	Actions	Irlande
AROUNDTOWN 0.625 2025_07	0,60%	-0,22%	0,00%	Obligations	Allemagne
AXA	0,59%	8,68%	0,05%	Actions	France
TOTAL	7,76%		0,32%		

Source : OFI AM

3 Meilleurs contributions sur le mois

Libellé	Poids	Performances	Contributions	Classe d'actif	Pays
ASML	1,44%	10,25%	0,13%	Actions	Pays-Bas
MERCK KGAA	0,44%	16,54%	0,06%	Actions	Allemagne
SAP	1,02%	5,48%	0,05%	Actions	Allemagne

Source : OFI AM

3 Moins bonnes contributions sur le mois

Libellé	Poids	Performances	Contributions	Classe d'actif	Pays
KERING	0,23%	-10,87%	-0,03%	Actions	France
ALLIANZ	0,43%	-5,25%	-0,02%	Actions	Allemagne
AMADEUS IT HLDG	0,29%	-6,37%	-0,02%	Actions	Espagne

Source : OFI AM

Principaux mouvements sur le mois

Achats / Renforcement		
Libellé	Poids M-1	Poids M
MUNICH RE 1.000 2042_05	Achat	0,63%
CM ARKEA 1.250 2029_06	Achat	0,51%
KBC GROEP 0.625 2031_12	Achat	0,48%
BECTON DICKINSON AND CO 0.000 2023_08	Achat	0,43%
NATIONAL GRID 0.250 2028_09	Achat	0,36%

Ventes / Allègement		
Libellé	Poids M-1	Poids M
CM ARKEA 1.625 2026_04	0,52%	Vente
KBC GROEP 0.125 2029_01	0,43%	Vente
ATOS 1.750 2025_05	0,34%	Vente
ANHEUSER BUSCH INBEV 2.000 2028_03	0,23%	Vente
ARGENTUM NETHERLANDS 1.125 2025_09	0,23%	Vente

Source : OFI AM

Commentaire de gestion

L'annonce des réductions de soutien monétaire de la part de la Réserve fédérale, et dans une moindre mesure de la BCE, s'est passée sans heurt jusqu'à présent. Ces dernières doivent veiller à ce que cela se poursuive durant la phase de sortie progressive de la pandémie dans les pays développés. Les taux devraient être modérément orientés à la hausse et ne pas inquiéter outre mesure les marchés d'actifs risqués.

Dans ce contexte nous conservons notre position neutre sur les actions dans nos allocations stratégiques, avec l'idée qu'une phase plus volatile sur les marchés - en lien avec des déceptions de résultats sur les actions au troisième trimestre ou sur fond de remontée des taux - pourra apporter la possibilité de se surpondérer sur des niveaux plus attractifs.

En effet, les mesures de relance annoncées dans les différents États apportent des perspectives positives pour les trimestres à venir... tant que les investisseurs seront rassurés par la politique des Banques Centrales pour gérer le niveau des taux d'intérêt.

M HABETS - J.P PORTA - Gérant(s)

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 Asset Management (22, rue Vernier 75017 Paris).

CONTACT • Département commercial • 01 40 68 17 17 • contact@ofi-am.fr

OFI Asset Management • Société de gestion de portefeuille agréée par l'AMF sous le numéro GP 92-12 • N° de TVA intra-communautaire : FR 51384940342 •

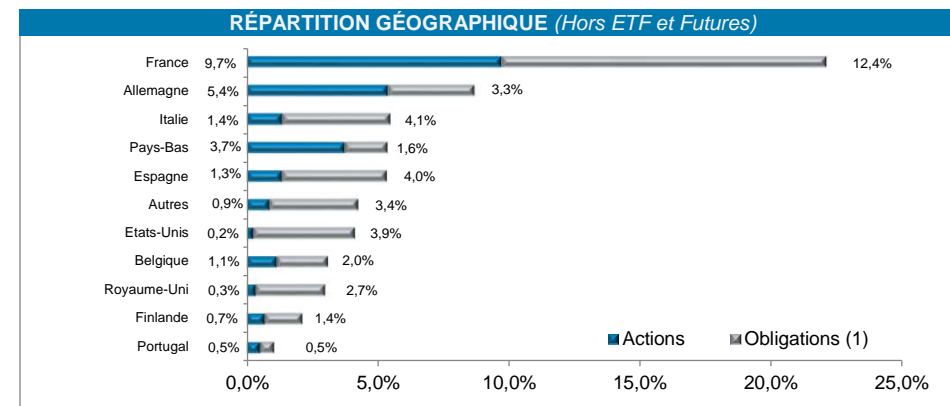
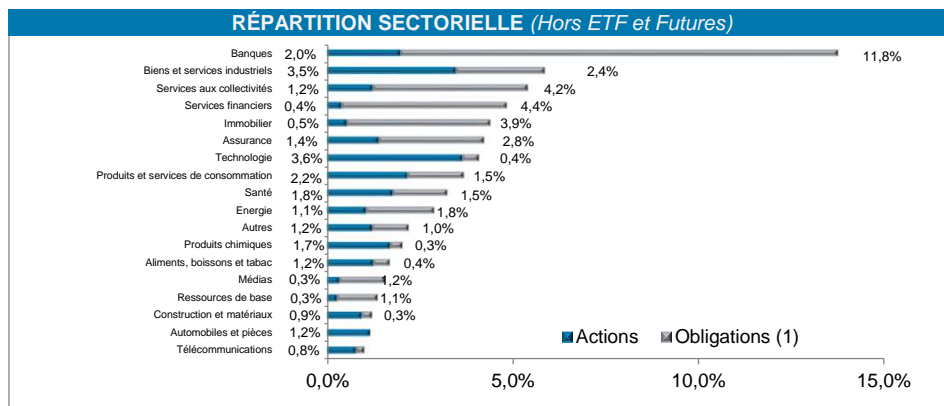
S.A à Conseil d'Administration au capital de 42 000 000 Euros • APE 6630Z 22 rue Vernier 75017 Paris •

Tél. : + 33 (0)1 40 68 17 17 • Fax : + 33 (0)1 40 68 17 18 • www.ofi-am.fr



OFI RS PRUDENT R

Reporting Mensuel - Diversifiés - août 2021



(1) Obligations libellées en euro. Le pays de l'émetteur peut être hors Zone Euro.

PROCESSUS D'EVALUATION ISR : EMETTEURS/SOCIETES

L'équipe de recherche ISR procède à l'analyse extra-financière :

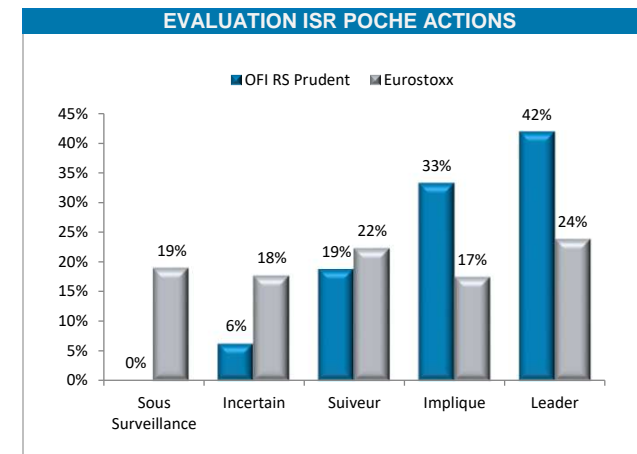
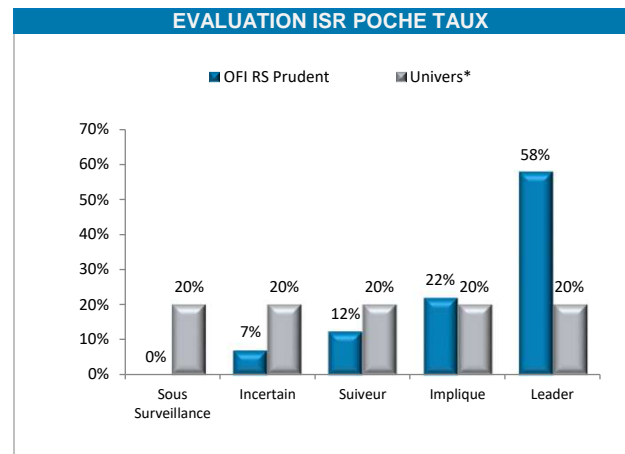
- des émetteurs privés / sociétés : identification des principaux enjeux ESG sectoriels puis analyse des pratiques de RSE des émetteurs
- des émetteurs publics : identification des principaux enjeux ESG des Etats Européens puis analyse de leurs pratiques.

Les résultats de cette analyse sont traduits par un Score ISR, établi sur une échelle de 0 à 5, reflet du classement de l'émetteur au sein de chaque super secteur ICB.

En fonction de ce Score ISR, une catégorie ISR est attribuée à chaque émetteur :

- Leaders** : les plus avancés dans la prise en compte des enjeux ESG
- Impliqués** : actifs dans la prise en compte des enjeux ESG
- Suiveurs** : enjeux ESG moyennement gérés
- Incertains** : enjeux ESG faiblement gérés
- Sous surveillance** : retard dans la prise en compte des enjeux ESG

*Univers : ensemble des émetteurs couverts par une analyse ESG(2700)



Indicateurs statistiques (fréquence hebdomadaire, comparés à l'indice de référence sur 1 an glissant)

Bêta	Alpha	Tracking Error	Ratio de Sharpe ⁽²⁾	Ratio d'Information	Fréquence de gain	Perte max.	Tracking Error**
0,88	0,02	3,88%	1,44	-0,67	57,69%	-9,28%	3,88%

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 Asset Management (22, rue Vernier 75017 Paris).

CONTACT • Département commercial • 01 40 68 17 17 • contact@ofi-am.fr

OFI Asset Management • Société de gestion de portefeuille agréée par l'AMF sous le numéro GP 92-12 • N° de TVA intra-communautaire : FR 51384940342 •
S.A à Conseil d'Administration au capital de 42 000 000 Euros • APE 6630Z 22 rue Vernier 75017 Paris •
Tél. : + 33 (0)1 40 68 17 17 • Fax : + 33 (0)1 40 68 17 18 • www.ofi-am.fr

