

Ofi Invest ESG Euro Equity Smart Beta R

Reporting Mensuel - Actions - août 2024



Ofi Invest ESG Euro Equity Smart Beta est un fonds investi essentiellement en actions de la zone Euro. À partir de l'univers de l'EuroStoxx, l'équipe de gestion met en oeuvre une approche innovante permettant de s'affranchir des biais liés à la « capi-pondération » des indices de référence. Les gérants ont développé une gestion dynamique combinant trois approches : Equal Risk contribution, Analyse ISR : approche « Best in class », Equipondération des valeurs. L'allocation entre les titres est réalisée trimestriellement.

Chiffres clés au 30/08/2024

Valeur Liquidative (en euros) :	124,55
Actif net de la Part (en euros) :	583 658,40
Actif net Total des Parts (en millions d'euros) :	103,96
Nombre de lignes :	192
Nombre d'actions :	191
Taux d'exposition actions :	99,74%

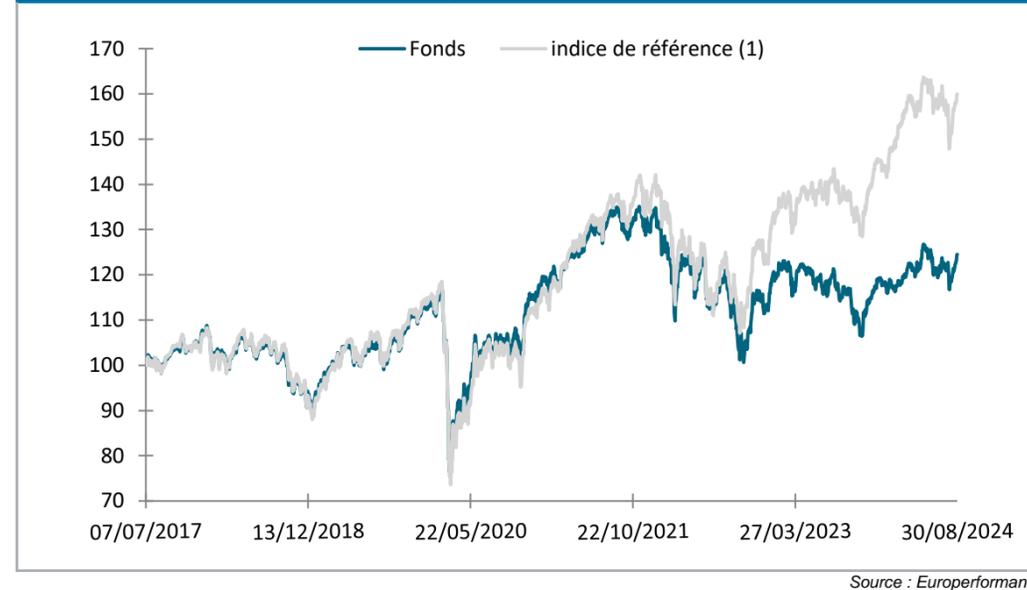
Caractéristiques du fonds

Code ISIN :	FR0013267135
Classification AMF :	Actions de pays de la zone Euro
Classification Europerformance :	Actions Euro - Général
Classification SFDR :	Article 8
Indice de référence (1) :	Euro Stoxx NR
Principaux risques :	Risque de capital et performance Risques de marché: actions et taux Risque de change
Société de gestion :	OFI INVEST ASSET MANAGEMENT
Gérant(s) :	Olivier KERJAN - Stéphane YOUMBI
Affectation du résultat :	Capitalisation
Devise :	EUR
Date de création :	07/07/2017
Horizon de placement :	Supérieur à 5 ans
Valorisation :	Quotidienne
Frais de gestion et autres frais administratifs et d'exploitation :	1,37%
Dépositaire :	SOCIETE GENERALE PARIS

Solvency Capital Requirement*



Evolution de la performance depuis création



Profil de risque

Niveau : 1 2 3 4 5 6 7

Performance sur le mois



Performance depuis le début de l'année



Performances & Volatilités

	Depuis création		5 ans glissants		3 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 Euro Equity Smart Beta R	24,55%	17,27%	20,66%	19,13%	-6,90%	14,71%	6,08%	11,70%	4,75%	10,55%	5,80%	-0,04%
Indice de référence (1)	59,94%	18,96%	53,91%	20,98%	17,17%	16,43%	15,11%	12,88%	10,24%	12,93%	4,71%	-0,64%

Source : Europerformance

Performances mensuelles

	Jan.	Fév.	Mars	Avr.	Mai	Juin	Juillet	Août	Sept.	Oct.	Nov.	Déc.	Année	Indice
2019	6,47%	2,89%	1,77%	2,97%	-4,26%	3,80%	0,05%*	-0,87%	3,37%	1,40%	3,15%	0,68%	23,77%	26,11%
2020	-1,38%	-7,12%	-15,17%	8,19%	5,04%	2,63%	-0,46%	3,14%	-0,70%	-4,72%	15,87%	2,04%	4,09%	0,25%
2021	-0,55%	0,37%	5,59%	1,42%	2,31%	1,30%	0,91%	2,33%	-3,27%	2,08%	-1,74%	3,34%	14,68%	22,67%
2022	-5,47%	-3,33%	0,53%	-0,56%	0,50%	-7,94%	5,04%	-5,54%	-8,71%	5,45%	6,18%	-2,52%	-16,46%	-12,31%
2023	6,94%	1,55%	-0,61%	0,45%	-3,90%	1,40%	2,03%	-2,78%	-4,23%	-3,89%	7,11%	2,72%	6,12%	18,55%
2024	-0,14%	-0,85%	4,07%	-0,91%	2,64%	-4,21%	2,82%	1,50%					4,75%	10,24%

Source : Europerformance

* Le SCR Market représente le besoin en capital en tenant compte de la corrélation entre les différents facteurs de risques

(1) Indice de référence : Euro Stoxx NR

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 Euro Equity Smart Beta R

Reporting Mensuel - Actions - août 2024

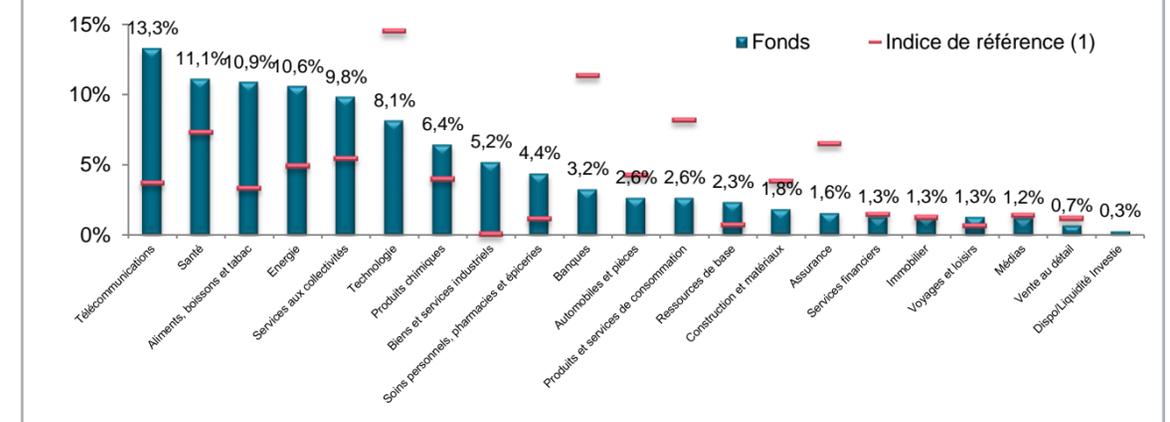


10 Principales Lignes (hors liquidités)

Libellé	Poids	Performances	Contributions	Pays	Secteur
CELLNEX TELECOM SA	2,04%	8,55%	0,16%	Espagne	Télécommunications
NOKIA	1,96%	9,86%	0,18%	Finlande	Télécommunications
ORANGE SA	1,94%	0,49%	0,01%	France	Télécommunications
ELISA	1,88%	5,11%	0,09%	Finlande	Télécommunications
FREENET AG	1,87%	3,05%	0,06%	Allemagne	Télécommunications
KONINKLIJKE KPN NV	1,82%	1,57%	0,03%	Pays-Bas	Télécommunications
NESTE	1,78%	13,34%	0,21%	Finlande	Energie
SES SA FDR	1,76%	-2,70%	-0,05%	Luxembourg	Télécommunications
KERRY GROUP PLC	1,58%	5,09%	0,08%	Irlande	Aliments, boissons et tabac
SIEMENS ENERGY N AG	1,54%	-3,20%	-0,05%	Allemagne	Energie
TOTAL	18,18%		0,72%		

Source : OFI Invest AM & Factset (Classification ICB - Niveau 2)

Répartition par secteur (Hors produits dérivés et Liquidités)



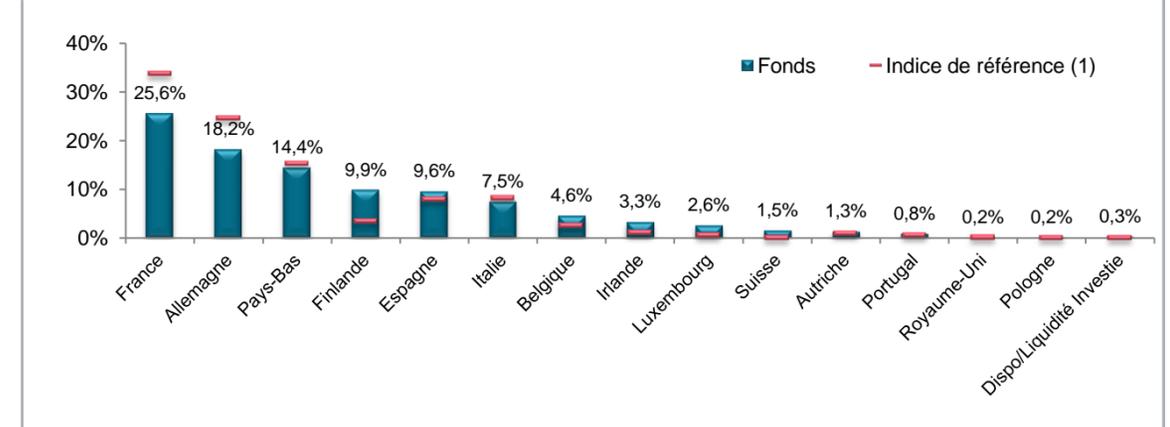
Source : OFI Invest AM & Factset (Classification ICB - Niveau 2)

3 Meilleures contributions sur le mois

Libellé	Poids	Performances	Contributions	Pays	Secteur
NESTE	1,78%	13,34%	0,21%	Finlande	Energie
NOKIA	1,96%	9,86%	0,18%	Finlande	Télécommunications
CELLNEX TELECOM SA	2,04%	8,55%	0,16%	Espagne	Télécommunications

Source : OFI Invest AM & Factset (Classification ICB - Niveau 2)

Répartition par zone géographique (Hors produits dérivés et Liquidités)



Source : OFI Invest AM & Factset

3 Moins bonnes contributions sur le mois

Libellé	Poids	Performances	Contributions	Pays	Secteur
GLANBIA PLC	1,16%	-13,47%	-0,18%	Irlande	Aliments, boissons et tabac
TECHNIP ENERGIES NV	1,42%	-8,98%	-0,14%	France	Energie
K S N AG	0,55%	-10,23%	-0,06%	Allemagne	Produits chimiques

Source : OFI Invest AM & Factset (Classification ICB - Niveau 2)

Principaux mouvements du mois

Achats / Renforcement		
Libellé	Poids M-1	Poids M
GLANBIA PLC		
TECHNIP ENERGIES NV		
SES SA FDR		
SIEMENS ENERGY N AG		
K S N AG		

Source : OFI Invest AM

Ventes / Allègement			
Libellé	Poids M-1	Poids M	
GLANBIA PLC	1,36%	1,16%	
TECHNIP ENERGIES NV	1,59%	1,42%	
SES SA FDR	1,84%	1,76%	
SIEMENS ENERGY N AG	1,61%	1,54%	
K S N AG	0,62%	0,55%	

Source : OFI Invest AM

Indicateurs statistiques*

Bêta	Alpha	Tracking Error	Ratio de Sharpe (2)	Ratio d'Information	Fréquence de gain	Perte max.
0,83	-0,11	5,38%	0,18	-1,548	55,77%	-9,22%

*Fréquence hebdomadaire, comparés à l'Euro Stoxx NR sur 1 an glissant

(2) Taux sans risque : EONIA

Source : Europerformance

Données Financières

	PER 2024 (3)	PER 2025 (3)	PTBV 2024 (4)	PTBV 2025 (4)
Fonds	14,04	12,72	1,53	1,44
Indice	13,02	11,96	1,66	1,55

(3) Price Earning Ratio = Cours / Bénéfice Net par Action anticipé

(4) Price to Book Value = Cours / Actif Net

Sources : Factset

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

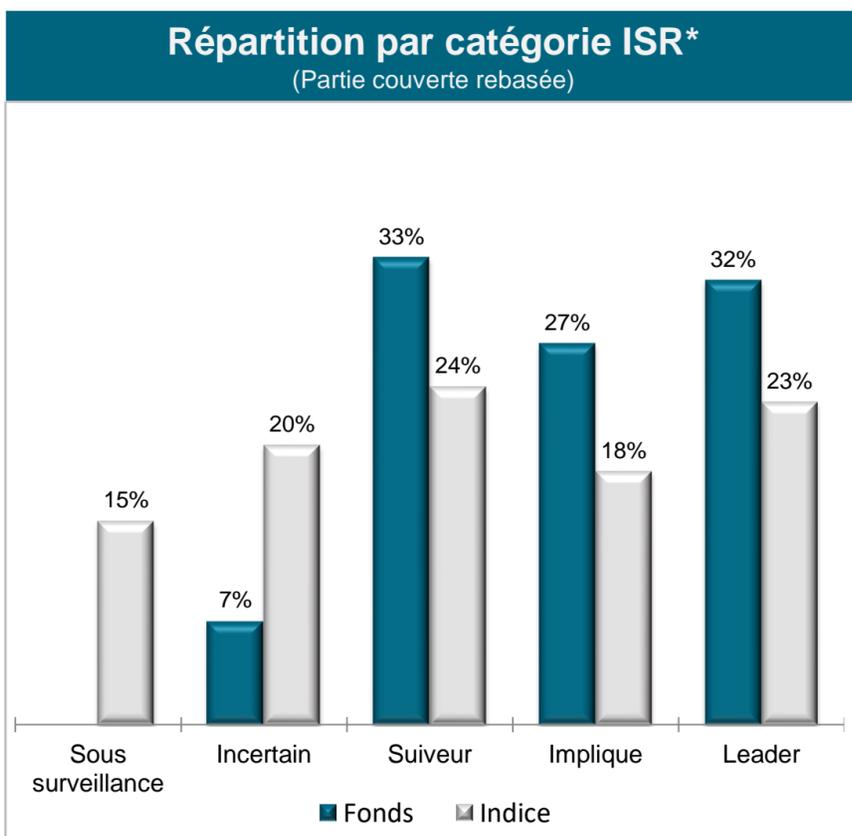
Ofi Invest Asset Management • société de gestion de portefeuille S.A. à Conseil d'Administration au capital de 71 957 490 euros • RCS Paris 384 940 342 • APE 6630 Z • Agrément AMF n°

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 Euro Equity Smart Beta R

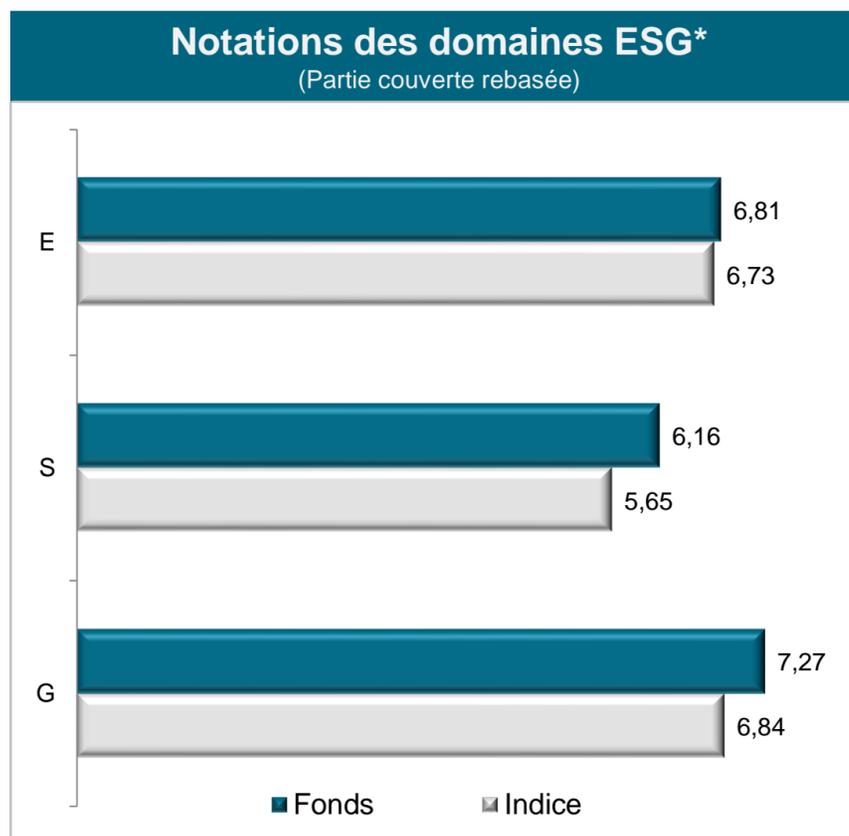
Reporting ISR Mensuel - août 2024



Taux de couverture du fonds (1) : 99.02%
Taux de couverture de l'indice : 99.72%

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.

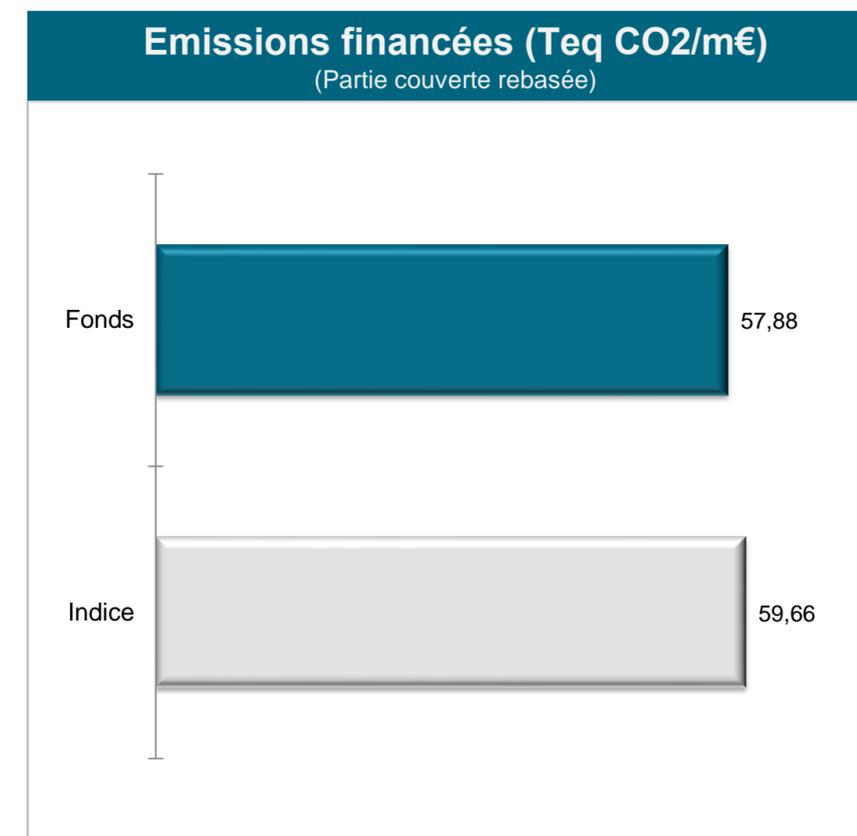
(1) Hors Disponibilité
Indice : CAT_ISR_EUROSTOXX



Taux de couverture du fonds (2) : 94.09%
Taux de couverture de l'indice : 97.35%

ESG : Environnement, Sociétal et de Gouvernance

(2) Hors Disponibilité et OPCVM



Taux de couverture du fonds (2) : 97.37%
Taux de couverture de l'indice : 99.21%

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-invest-am.com/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