

Ofi Invest Performance Diversifié

FRO011220292

Reporting trimestriel au 30 septembre 2022



- Valeur liquidative : 167,35 €
- Actif net du fonds : 63 509 945 €
- Évolution de la performance



(base 100 au 29 sept. 2017)

■ Performances cumulées

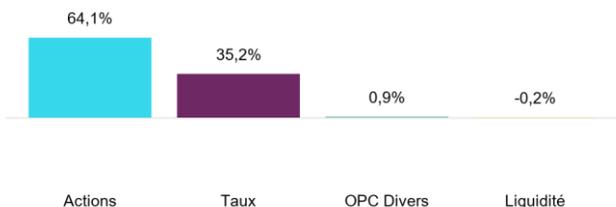
	1M	Ytd	1Y	3Y	5Y	8Y	10Y
Fonds	-6,0%	-17,8%	-14,4%	-3,6%	-5,6%	19,5%	55,8%
Indice de référence	-5,2%	-16,5%	-12,0%	-0,5%	10,0%	37,2%	78,1%

■ Performances annuelles

	2016	2017	2018	2019	2020	2021
Fonds	5,2%	7,2%	-14,9%	20,3%	-0,4%	14,5%
Indice de référence	6,8%	7,3%	-6,3%	21,6%	-1,2%	17,5%

Les performances passées ne préjugent pas des performances futures. La valeur d'un investissement dans l'OPC peut fluctuer à la hausse comme à la baisse. Les performances présentées s'entendent dividendes/coupons réinvestis. Le calcul de performance des indices composés de plusieurs indices est rebalancé tous les mois.

■ Répartition par type d'instrument



■ Principaux indicateurs de risque

	Fonds	Indice de référence	
Sensibilité (Poche taux)	2,14	2,25	
Max drawdown * (1)	-26,0	-28,8	
Délai de recouvrement * (1)	357	357	
	1Y	3Y	5Y
Ratio de Sharpe *	-1,13	-0,00	-0,06
Ratio d'information *	-0,98	-0,41	-1,07
Tracking error *	2,67	2,64	2,90
Volatilité fonds *	13,21	16,33	14,31
Volatilité indice *	13,43	16,68	14,11

* Source : Six Financial Information

(1) sur 156 semaines (arrêté au dernier vendredi du mois)

■ Date de création

22 mai 2012

■ Forme juridique

FCP de droit français

■ Devise

EUR (€)

■ Intensité carbone

Fonds 132,28
Indice 180,33

■ Couverture intensité carbone

Fonds 53,71%
Indice 97,52%

Tonne(s) de CO2 par million de \$ de revenus (source : BRS & MSCI)

■ Score ESG

Fonds 7,03
Indice 6,96

■ Couverture score ESG

Fonds 53,53%
Indice 97,77%

■ Orientation de gestion

Le FCP a pour objectif de bénéficier, sur un horizon de placement supérieur à trois ans, d'un investissement diversifié sur les marchés actions et obligataires de toutes zones géographiques, tout en optimisant le profil de risque / rendement du fonds.

Le FCP appartient à la catégorie fonds de fonds pouvant investir jusqu'à 100% de son actif net en parts ou actions d'OPC.

L'indicateur de référence est l'indice composite suivant, libellé en euro et calculé coupons/dividendes réinvestis : 50% CAC All-Tradable® (indice actions françaises) ; 17,5% JPM EMU, (indice représentatif des emprunts gouvernementaux de la zone euro) ; 15% Eurostoxx® 50 (indice actions de la zone euro) ; 12,5% Bloomberg Barclays Capital Global Aggregate Credit, (indice représentatif des emprunts d'émetteurs privés de la catégorie « investissement ») ; 5% Bloomberg Barclays Capital Global High Yield (indice représentatif des emprunts d'émetteurs privés de la catégorie « haut rendement »).

L'allocation sera gérée activement entre les différentes classes d'actifs représentées en tenant régulièrement compte de la volatilité des marchés.

■ Indice de référence

50% CAC® All-Tradable + 17,5% JPM EMU + 15% EURO STOXX® 50 + 12,5% Bloomberg Barclays Capital Global Aggregate Crédit + 5% Bloomberg Barclays Capital Global High Yield (dividendes/coupons nets réinvestis)

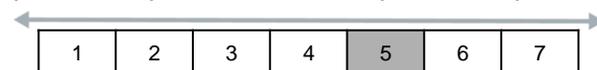
■ Durée de placement minimum recommandée

Supérieure à 3 ans

■ Profil de risque et de rendement

A risque plus faible, rendement potentiellement plus faible

A risque plus élevé, rendement potentiellement plus élevé



SRRI (Synthetic Risk & Reward Indicator) : Indicateur de risque fondé sur la volatilité sur une période de 260 semaines. Les données historiques telles que celles utilisées pour calculer l'indicateur synthétique pourraient ne pas constituer une indication fiable du profil de risque futur. La catégorie de risque associée à cet OPC n'est pas garantie et pourra évoluer dans le temps. La catégorie la plus faible ne signifie pas « sans risque ».

■ Notation(s)

Six Financial Information

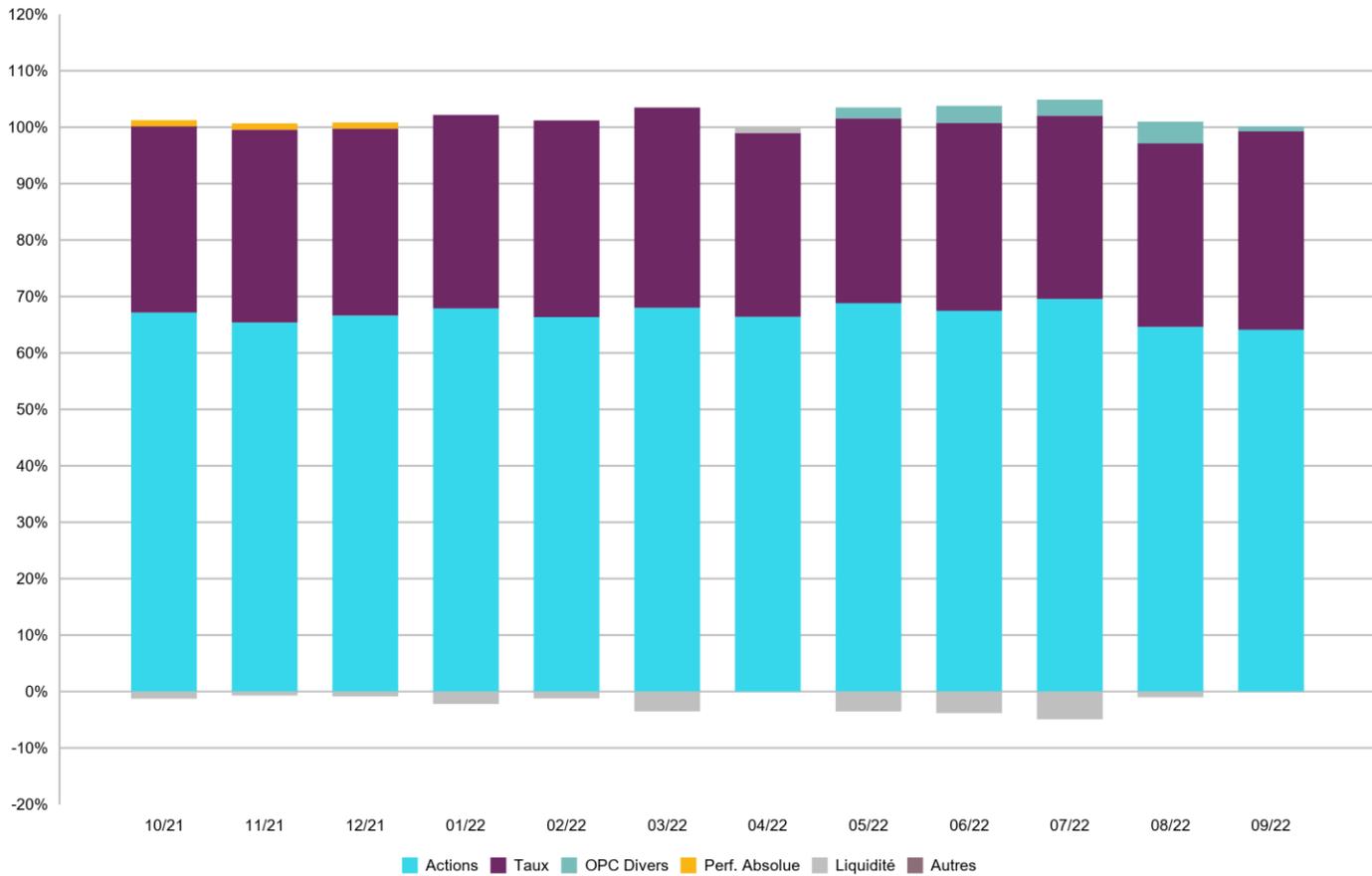


Ofi Invest Performance Diversifié

FRO011220292

Reporting trimestriel au 30 septembre 2022

Allocation historique



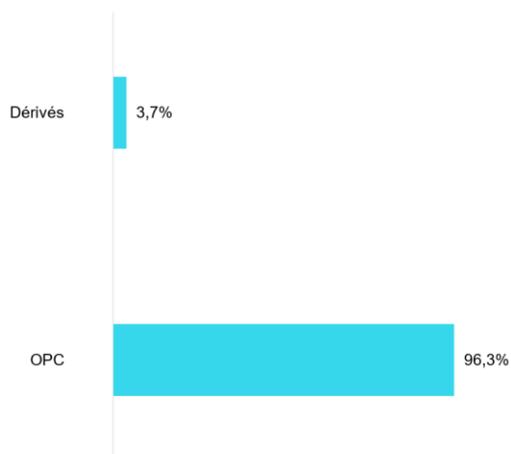
Gérant allocation

Jean-François Fossé



■ Proportion de la poche actions dans le portefeuille global : 64,1%

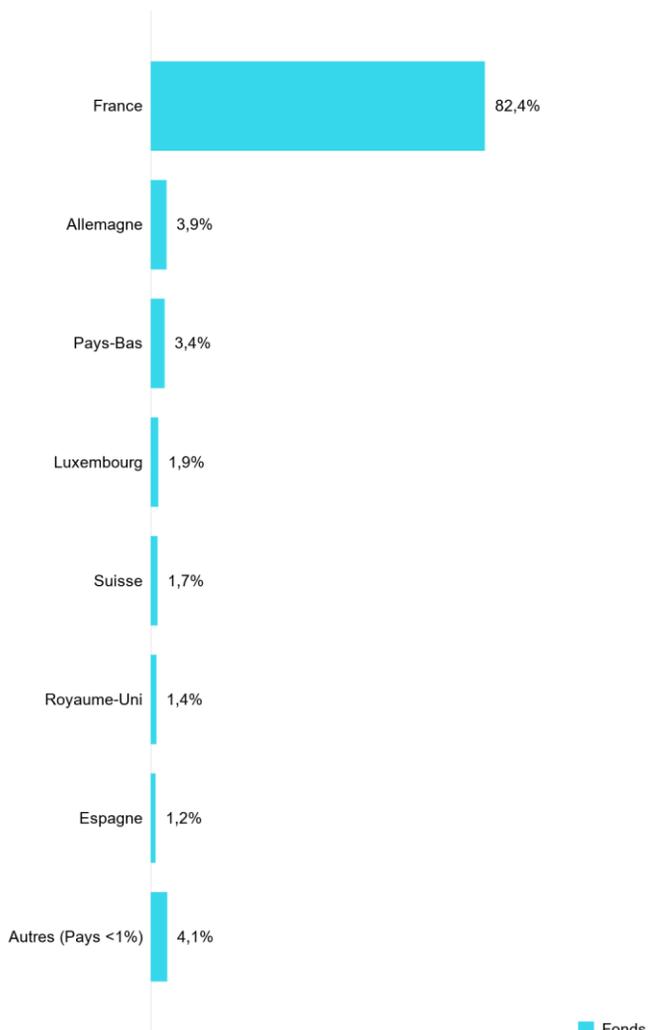
■ Répartition - Poche actions



■ Principales positions - Poche actions

Nom	Pays	Secteur	% Actif
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	France	Produits ménagers et de soin personnel	6,1%
TOTALENERGIES SE	France	Pétrole et gaz	5,3%
SANOFI SA	France	Santé	4,2%
LOREAL SA	France	Produits ménagers et de soin personnel	3,5%
SCHNEIDER ELECTRIC SE	France	Biens et services industriels	3,2%
LAIR LIQUIDE SA POUR LETUDE ET LEXPLO DES PROCEDES GEORGES CLAUDE SA	France	Chimie	2,9%
BNP PARIBAS SA	France	Banques	2,4%
AIRBUS SE	France	Biens et services industriels	2,2%
ESSILORLUXOTTICA SA	France	Santé	2,0%
AXA SA	France	Assurance	1,9%

■ Répartition géographique - Poche actions



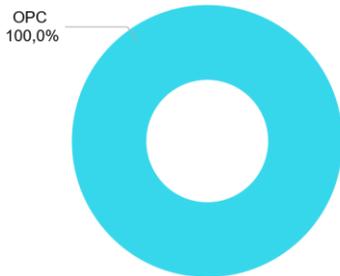
■ Principaux mouvements - Poche actions

Achats/renforcements

Ventes/allègements

■ Proportion de la poche taux dans le portefeuille global : 35,2%

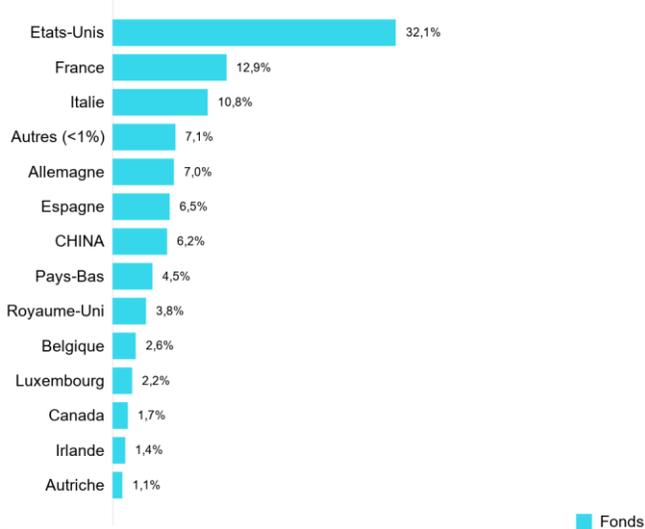
■ Répartition - Poche taux



■ Principales positions - Poche taux (hors dérivés)

Nom	Pays	Secteur	Rating	% Actif
ISHARES CHINA CNY BOND UCITS ETF U (ALDP)	CHINA	-	-	2,1%
SPAIN (KINGDOM OF) - 31/01/28	Espagne	Souverains (OCDE)	A	0,3%
FRANCE (REPUBLIC OF) - 25/02/26	France	Souverains (OCDE)	AA	0,3%
UNITED STATES OF AMERICA BOND FIXED 2% 15/NOV/2041 USD 100 (ALDP) - 15/11/41	USA	Souverains (OCDE)	AAA	0,3%
FRANCE (REPUBLIC OF) - 25/05/26	France	Souverains (OCDE)	AA	0,2%

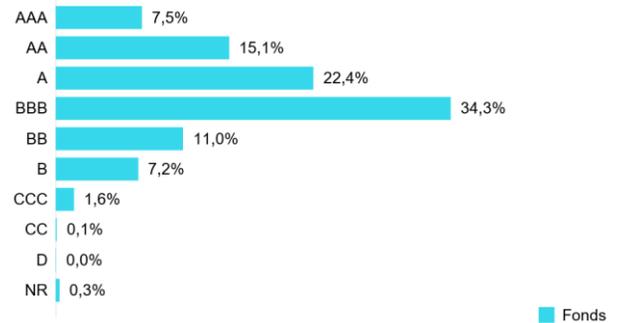
■ Répartition géographique - Poche taux



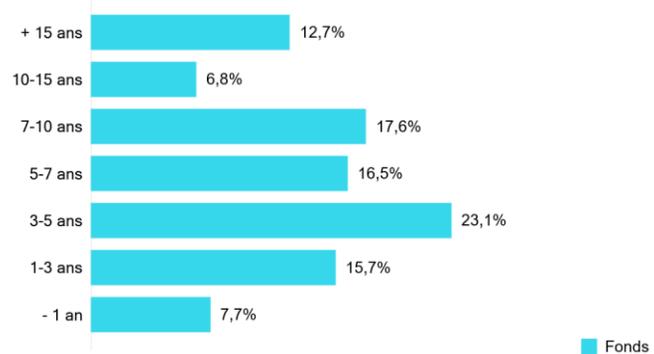
■ Indicateur de risques - Poche taux

	Fonds	Indice de référence
Sensibilité	2,1	2,2

■ Répartition par rating - Poche taux



■ Répartition par maturité - Poche taux



Ofi Invest Performance Diversifié

FR0011220292

Reporting trimestriel au 30 septembre 2022



Principales caractéristiques

Société de gestion	Abeille Asset Management	Dépositaire	Société Générale S.A.
Code ISIN	FR0011220292	Conservateur	Société Générale S.A.
Forme juridique	FCP de droit français	Heure limite de souscription	11h30
Date de création	22 mai 2012	Droits d'entrée max	4.0%
Durée de placement min. recommandée	Supérieure à 3 ans	Frais de gestion max TTC	0,35%
Fréquence de valorisation	Hebdomadaire	Commission de surperformance	Non
Investissement min. initial	1 part	Publication des VL	www.ofi-invest-am.com
Investissement min. ultérieur	Néant	Commissaire aux comptes	KPMG Audit
Indice de référence	50% CAC® All-Tradable + 17,5% JPM EMU + 15% EURO STOXX® 50 + 12,5% Bloomberg Barclays Capital Global Aggregate Crédit + 5% Bloomberg Barclays Capital Global High Yield (dividendes/coupons nets réinvestis)	Affectation des résultats	Capitalisation
		Ticker Bloomberg	AIFAPDI

Définitions

La **Tracking error** est la mesure du risque relatif pris par un fonds par rapport à son indice de référence. Elle est donnée par l'écart type annualisé des performances relatives d'un fonds par rapport à son indice de référence. Plus elle est faible, plus le fonds possède un profil de risque proche de son indice de référence.

Le **Ratio de Sharpe** mesure l'écart de rendement d'un portefeuille par rapport au taux de rendement d'un placement sans risque (prime de risque), divisé par un écart type de la rentabilité de ce portefeuille (volatilité).

Un ratio de Sharpe élevé est un bon indicateur.

La perte maximale (**Max drawdown**) correspond au rendement sur la période de placement la plus mauvaise possible. Elle indique la perte maximale qu'un investisseur aurait pu subir s'il avait acheté le fonds au plus haut de la période d'observation et l'avait vendu au plus bas durant cette période.

L'**intensité carbone** représente le total des émissions de gaz à effet de serre (GES) des scopes 1 & 2 (émissions directes & émissions indirectes liées aux consommations énergétiques) normalisé par million de \$ de revenus (chiffre d'affaires). Ainsi, pour chaque million de dollar de revenus, X tonnes métriques d'émissions sont financées.

Contacts

Ofi Invest Asset Management : 14, rue Roquépine - 75008 Paris

Tel : 01 76 62 90 00 - Fax : 01 76 62 91 00

Email : contact.clients.am@ofi-invest.com

Information importante

Cette communication est conçue à des fins d'information et est destinée exclusivement à des investisseurs professionnels et contreparties éligibles au sens de la Directive "MIF 2" n°2014/65/UE et 2016/1034 relative aux marchés d'instruments financiers.

Elle ne saurait être assimilée à une activité de démarchage, à une quelconque offre de valeur mobilière ou d'instrument financier ou à une recommandation d'en acheter ou d'en vendre.

Elle contient des éléments d'information et des données chiffrées qu'Abeille Asset Management considère comme fondés ou exacts au jour de leur établissement. Pour ceux de ces éléments qui proviennent de sources d'information externes, leur exactitude ne saurait être garantie.

Ce document d'information ne donne aucune assurance de l'adéquation des OPC gérés par Abeille Asset Management à la situation financière, au profil de risque, à l'expérience ou aux objectifs de l'investisseur. Avant d'investir dans un OPC, l'investisseur doit procéder à sa propre analyse en s'appuyant sur les conseils de son choix. Abeille Asset Management décline toute responsabilité quant à d'éventuels dommages ou pertes résultant de l'utilisation en tout ou partie des éléments figurant dans ce document d'information.

Les analyses présentées reposent sur des hypothèses et des anticipations d'Abeille Asset Management, faites au moment de la rédaction du document qui peuvent être totalement ou partiellement non réalisées sur les marchés. Elles ne constituent pas un engagement de rentabilité et sont susceptibles d'être modifiées.

La valeur d'un investissement sur les marchés peut fluctuer à la hausse comme à la baisse, et peut varier en raison des variations des taux de change. En fonction de la situation économique et des risques de marché, aucune garantie n'est donnée sur le fait que les produits ou services présentés puissent atteindre leurs objectifs d'investissement. Les performances passées ne préjugent pas des performances futures.

Le Document d'Information Clé pour l'Investisseur (DICI), le prospectus ainsi que les derniers états financiers disponibles des OPC gérés par Abeille Asset Management, sont à la disposition du public sur simple demande, auprès d'Abeille Asset Management.

Ce document d'information ne peut être reproduit sous quelque forme que ce soit ou transmis à une autre personne que celle à qui il est adressé.

Ce document d'information est établi par Ofi Invest Asset Management, dénomination commerciale d'Abeille Asset Management, société de gestion de portefeuille de droit français agréée par l'Autorité des Marchés Financiers (AMF) sous le n° GP 97-114, Société Anonyme à Directoire et Conseil de Surveillance au capital de 18.608.050 euros, dont le siège social est situé au 14 rue Roquépine, 75008 Paris, immatriculée au Registre du Commerce et des Sociétés de Paris sous le numéro 335 133 229. Abeille Asset Management est membre d'Aérama Groupe depuis le 30 septembre 2021.

Sources pour toutes les données : Abeille Asset Management

Les OPC sous-jacents de la gamme Abeille Asset Management détenus en portefeuille, sont calculés par transparence.