Ofi Invest ISR Patrimoine Monde Opportunités

FR0007020037

Reporting mensuel au 31 octobre 2022

Valeur liquidative : 90,63 €

Actif net du fonds : 106 732 599 €

Évolution de la performance

(base 100 au 2 nov. 2017)

Performances cumulées

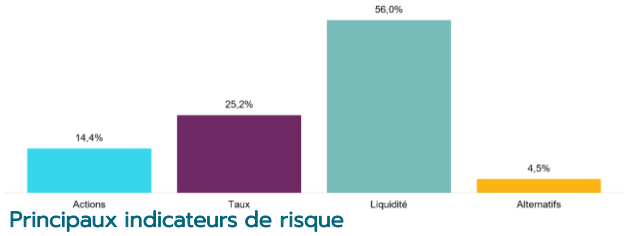
	1M	Ytd	1Y	3Y	5Y	8Y	10Y
Fonds	-0,1%	-8,8%	-8,3%	-9,9%	-15,4%	-10,4%	0,6%
Indice de référence	-	-	-	-	-	-	-

Performances annuelles

	2016	2017	2018	2019	2020	2021
Fonds	0,4%	-0,6%	-10,1%	6,7%	-4,3%	2,8%
Indice de référence	-	-	-	-	-	-

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 de l'exposition



Principaux indicateurs de risque

	Fonds	Indice de référence
Sensibilité	0,49	-
Max drawdown * (1)	-11,83	-
Délai de recouvrement * (1)	-	-
Yield to Worst	1,47	

	1Y	3Y	5Y
Ratio de Sharpe *	-2,25	-0,61	-0,60
Ratio d'information *	-	-	-
Tracking error *	-	-	-
Volatilité fonds *	3,69	4,90	4,84
Volatilité indice *	-	-	-
Corrélation (actions)	-	-	-
Beta (actions)	-	-	-

* Source : Six Financial Information

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

Date de création

13 avril 1998

Forme juridique

FCP de droit français

Devise

EUR (€)

Intensité carbone

Fonds	Indice
126,61	-

Couverture intensité carbone

Fonds	Indice
67,38%	-

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

Score ESG

Fonds	Indice
7,37	-

Couverture score ESG

Fonds	Indice
67,25%	-

Dernier détachement

Date	Montant net
-	-

Orientation de gestion

Le FCP est un nourricier de l'OPCVM Maître Ofi Invest ISR Patrimoine Monde M. Son objectif de gestion est identique à celui de l'OPCVM Maître, c'est-à-dire "obtenir, sur la durée de placement recommandée de 5 ans (après déduction des frais courants), la performance la plus élevée possible au moyen d'une gestion dynamique de l'allocation entre les marchés d'actions internationaux et les marchés de taux internationaux dans le cadre d'une contrainte de volatilité annuelle inférieure à 5% et en appliquant un filtre ISR (Investissement Socialement Responsable)". Sa performance pourra être inférieure à celle de l'OPCVM Maître du fait de ses frais de gestion financière propres.

Indice de référence

-

Durée de placement minimum recommandée

5 ans

Profil de risque et de rendement

A risque plus faible, rendement potentiellement plus faible — **A risque plus élevé, rendement potentiellement plus élevé**

1	2	**3**	4	5	6	7

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)

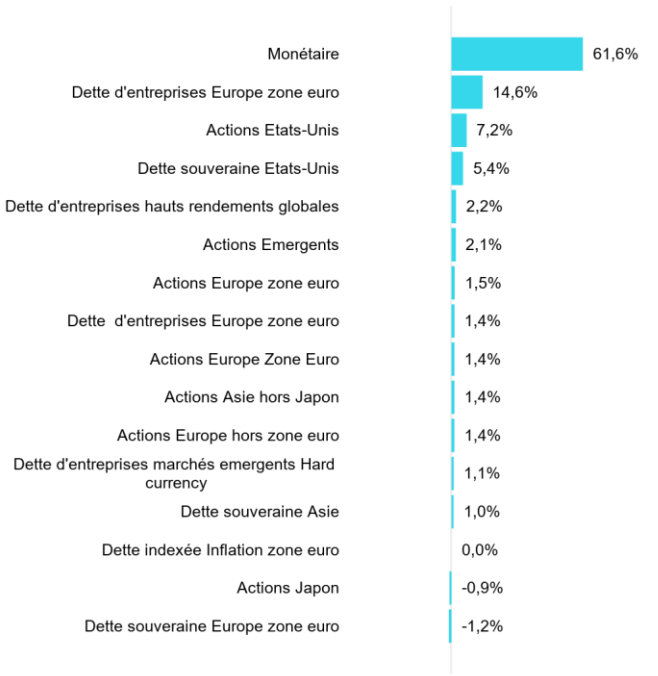
Six Financial Information

Ofi Invest ISR Patrimoine Monde Opportunités

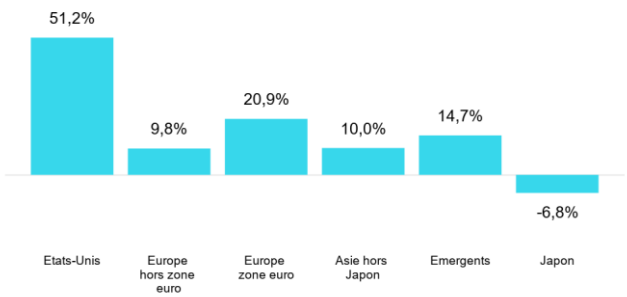
FR0007020037

Reporting mensuel au 31 octobre 2022

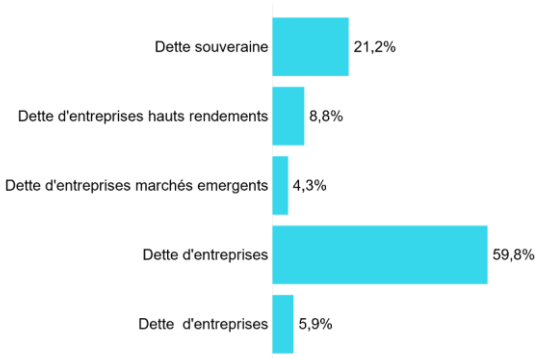
Répartition par type d'exposition



Décomposition de la poche actions



Décomposition de la poche taux



Principales positions

Nom	% Actif
Ofi Invest ISR Monétaire I	19,9%
Ofi Invest ISR Monétaire CT D	19,5%
Ofi Invest ISR Crédit Court Euro R	12,5%
C SPX 3950 11/2022 (ALDP)	12,0%
US ULTRA 10YR NOTE DEC 22 (ALDP)	4,5%
Ofi Invest ISR Crédit Bonds Euro I	2,5%
CANDRIAM SST BD GLBL HY EURO	2,2%
AB SUSTAINABLE US TMTC S1	2,0%
SOCIETE GENERALE SA ESTR 0.12 3/2023 - 31/03/23	1,9%
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA ESTR 0.11 1/2023 - 30/01/23	1,9%

Principaux mouvements

Achats/renforcements

Ofi Invest ISR Monétaire CT D
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 11/2022 - 10/11/22
SOCIETE GENERALE SA ESTR 0.12 3/2023 - 31/03/23
NESTLE FINANCE INTERNATIONAL LTD 11/2022 - 10/11/22
NATIXIS SA ECBAMIN 0.07 1/2023 - 23/01/23

Ventes/allègements

Ofi Invest ISR Crédit Court Euro R
Ofi Invest ISR Crédit Court Euro R
SOCIETE GENERALE SA 10/2022 - 07/10/22 - 07/10/22
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 10/2022 - 07/10/22 - 07/10/22
Ofi Invest ISR Monétaire CT D

Commentaire de gestion

Les actifs à risque ont vécu un mois d'octobre agité, marqué par la crise politique et financière au Royaume-Uni et le contexte inflationniste des deux côtés de l'Atlantique. Pour autant, le bilan s'avère finalement très positif pour les marchés d'actions grâce à un début de saison de publications de résultats d'entreprises globalement meilleur que prévu et à la détente des taux longs à la fin du mois. Côté action, aux Etats Unis le Dow Jones a rebondi de près de 14 %. Il s'agit de sa plus forte hausse mensuelle en 46 ans tirée par la détente des taux longs à la fin du mois et par les valeurs comme l'énergie ou les banques.

Du côté des marchés émergents, le bilan est bien plus mitigé. Les actions chinoises ont souffert de la volonté affichée des Etats-Unis de se défaire de leur dépendance commerciale dans le domaine technologique. On a assisté à une forte volatilité du marché obligataire en octobre. Les taux d'intérêt longs ont grimpé sur de nouveaux sommets (4,2% sur le taux à 10 ans américain et 2,4% sur le Bund allemand) en raison du contexte inflationniste qui conduira les banques centrales à relever davantage leurs taux directeurs pour endiguer l'inflation.

L'indice EuroStoxx gagne 0.08% et l'indice Barclays EuroAgg Corp progresse de 0.00%. A la fin octobre, l'exposition du fonds à son allocation stratégique cible est de 27%. Pour rappel, l'allocation stratégique cible est composée de 42% d'actions et de 43% d'obligations d'états et d'entreprises.

Ofi Invest ISR Patrimoine Monde Opportunités

FR0007020037

Reporting mensuel au 31 octobre 2022

Principales caractéristiques

Société de gestion	Abeille Asset Management	Dépositaire	Société Générale S.A.
Code ISIN	FR0007020037	Conservateur	Société Générale S.A.
Forme juridique	FCP de droit français	Heure limite de souscription	18h00 le jour ouvré précédant le jour d'établissement de la VL
Date de création	13 avril 1998	Droits d'entrée max	4.0%
Durée de placement min. recommandée	5 ans	Frais de gestion max TTC	1.0%
Fréquence de valorisation	Journalière	Commission de surperformance	Non
Investissement min. initial	Néant	Publication des VL	www.ofi-invest-am.com
Investissement min. ultérieur	Néant	Commissaire aux comptes	Deloitte & Associés
Indice de référence	-	Affectation des résultats	Capitalisation
		Ticker Bloomberg	VICPRUC

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 l'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.

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'Aéma 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.

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