Ofi Invest ISR Actions Europe

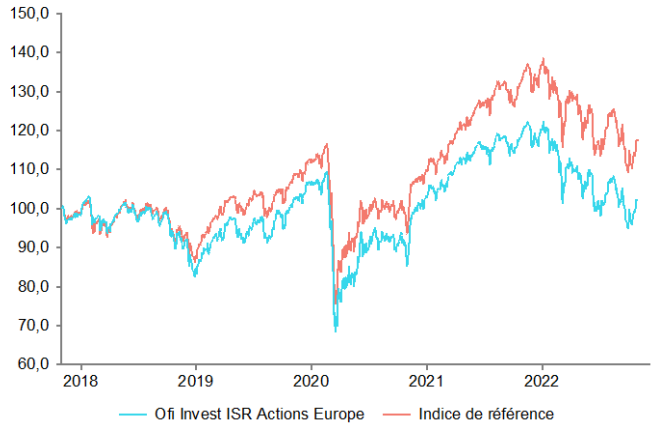
FR0007473798

Reporting mensuel au 31 octobre 2022

Valeur liquidative : 87,95 €

Actif net du fonds : 39 882 221 €

Évolution de la performance



(base 100 au 31 oct. 2017)

Performances cumulées

	1M	Ytd	1Y	3Y	5Y	8Y	10Y
Fonds	6,5%	-14,9%	-14,2%	2,1%	2,2%	41,4%	92,6%
Indicateur de référence	6,6%	-13,9%	-11,5%	10,7%	17,8%	50,0%	97,6%

Performances annuelles

	2016	2017	2018	2019	2020	2021
Fonds	6,7%	13,9%	-13,7%	25,1%	-3,1%	16,9%
Indicateur de référence	1,7%	10,6%	-10,8%	26,8%	-2,0%	24,9%

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.

Principaux indicateurs de risque *

	Fonds	Indice de référence
Max drawdown (1)	-37,8	-35,4
Délai de recouvrement (1)	376	358

	1Y	3Y	5Y
Ratio de Sharpe *	-0,86	0,05	0,04
Ratio d'information *	-1,04	-0,74	-0,75
Tracking error *	2,98	3,66	3,86
Volatilité fonds *	17,68	23,30	20,17
Volatilité indice *	17,88	21,83	18,59

* Source : Six Financial Information

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

Notation(s)

Six Financial Information

★★

Date de création

18 mai 1993

Forme juridique

FCP de droit français

Devise

EUR (€)

Intensité carbone

Fonds	Indice
93,55	116,32

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

Couverture intensité carbone

Fonds	Indice
99,50%	99,92%

Score ESG

Fonds	Indice
8,00	7,86

Couverture score ESG

Fonds	Indice
99,50%	99,92%

Dernier détachement

Date	Montant net
-	-

Orientation de gestion

Le FCP est un nourricier de l'OPCVM Maître Ofi Invest ISR Valeurs Europe. Son objectif de gestion est identique à celui de l'OPCVM Maître, c'est-à-dire "de réaliser sur la durée de placement recommandée, supérieure à cinq ans, une performance supérieure à celle de l'indicateur de référence le MSCI Europe Ex UK, en appliquant un filtre ISR (Investissement Socialement Responsable) et en fonction du dynamisme du marché des actions européennes dans le cadre du PEA".
Sa performance pourra être inférieure à celle de l'OPCVM Maître du fait de ses frais de gestion financières propres. Par ailleurs, en dépit de l'orientation de gestion du Maître, le FCP nourricier n'est pas éligible au PEA.

Indice de référence

MSCI Europe ex UK (dividendes nets réinvestis)

Durée de placement minimum recommandée

Supérieure à 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 ».

Gérant(s)

Françoise Labbé



Frédéric Tassin

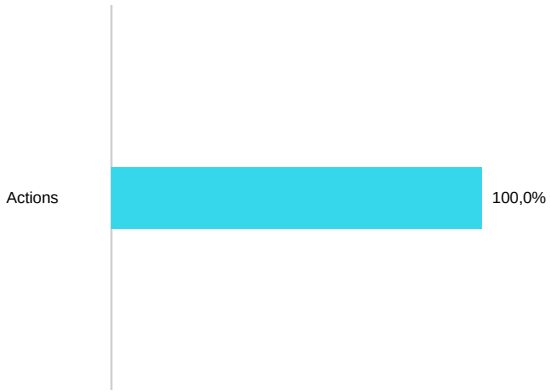


Ofi Invest ISR Actions Europe

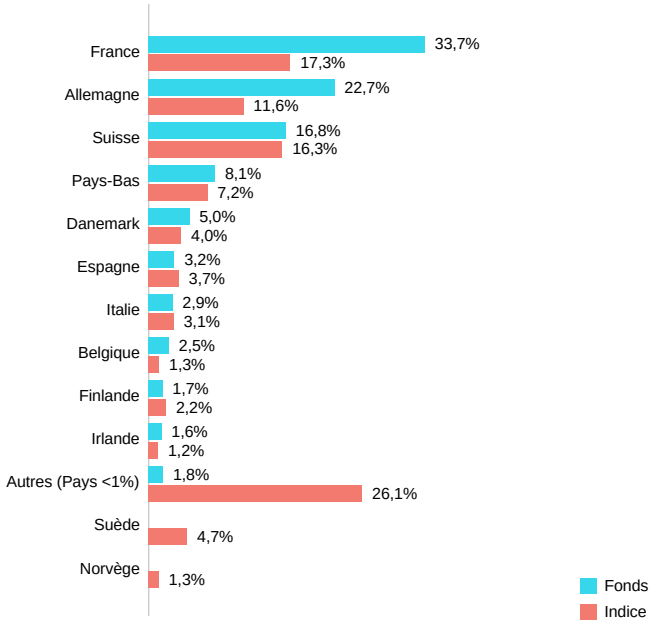
FR0007473798

Reporting mensuel au 31 octobre 2022

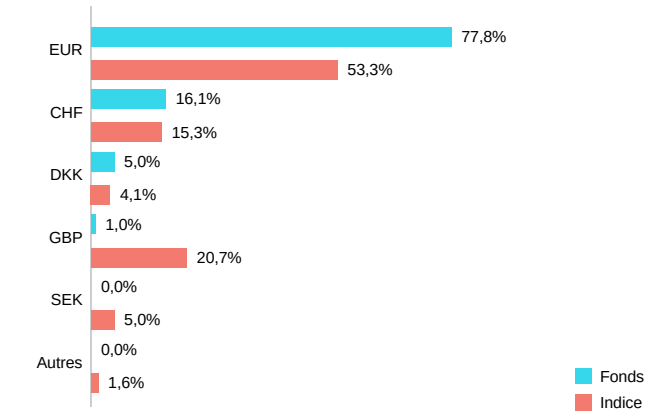
Répartition par type d'actif



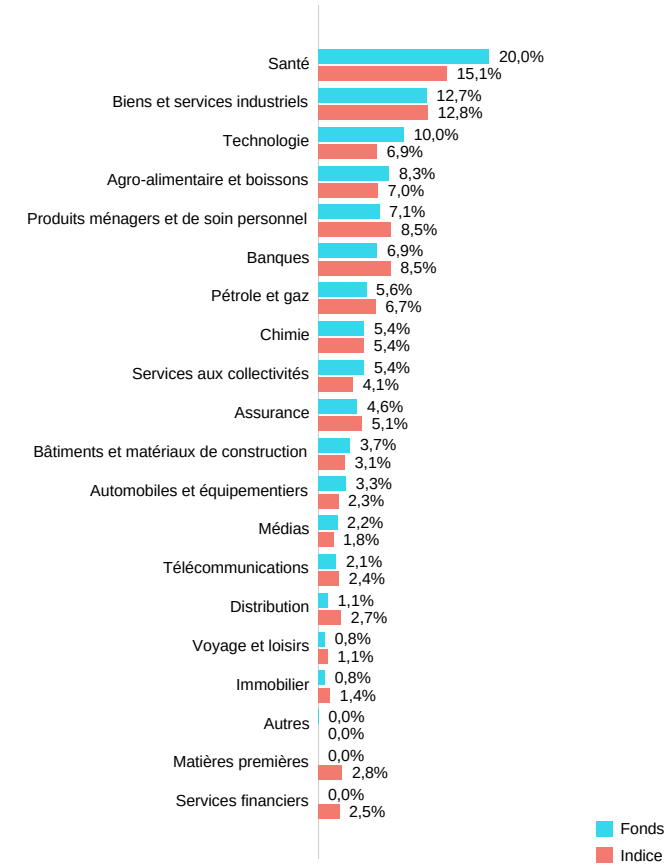
Répartition géographique



Répartition par devise



Répartition par secteur



Principales positions

Nom	Pays	Secteur	% Actif
ROCHE HOLDING AG	Suisse	Santé	3,7%
NESTLE SA	Suisse	Agro-alimentaire et boissons	3,4%
ASML HOLDING NV	Pays-Bas	Technologie	3,1%
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	France	Produits ménagers et de soin personnel	2,8%
NOVO NORDISK A/S	Danemark	Santé	2,6%
NOVARTIS AG	Suisse	Santé	2,0%
ALLIANZ SE	Allemagne	Assurance	2,0%
TOTALENERGIES SE	France	Pétrole et gaz	2,0%
SANOFI SA	France	Santé	2,0%
SAP SE	Allemagne	Technologie	1,8%

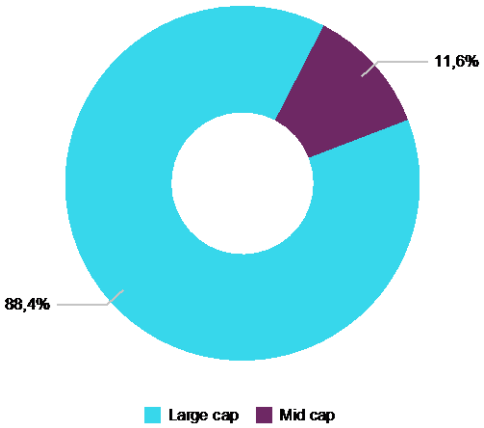
Nombre total de lignes (action) : 92

Ofi Invest ISR Actions Europe

FR0007473798

Reporting mensuel au 31 octobre 2022

Répartition par taille de capitalisation



Large cap : sup. 10 milliards €
Mid cap : entre 500 millions et 10 milliards €
Small cap : inf. 500 millions €.

La ventilation concerne les actions détenues en direct et par transparisation.

Principales surpondérations

Nom	Secteur	% Actif	Surpondération
COMMERZBANK AG	Banques	1,4%	1,3%
SOCIETE GENERALE SA	Banques	1,5%	1,2%
ALLIANZ SE	Assurance	2,0%	1,2%
UCB SA	Santé	1,2%	1,1%
THALES SA	Biens et services industriels	1,2%	1,1%

Principales sous-pondérations

Nom	Secteur	% Actif	Sous-pondération
SHELL PLC	Pétrole et gaz	0,0%	-2,1%
ASTRAZENECA PLC	Santé	0,0%	-1,9%
LINDE PLC	Chimie	0,0%	-1,6%
HSBC HOLDINGS PLC	Banques	0,0%	-1,2%
BP PLC	Pétrole et gaz	0,0%	-1,1%

Ofi Invest ISR Actions Europe

FR0007473798

Reporting mensuel au 31 octobre 2022

Principales caractéristiques

Société de gestion	Abeille Asset Management	Dépositaire	Société Générale S.A.
Code ISIN	FR0007473798	Conservateur	Société Générale S.A.
Forme juridique	FCP de droit français	Heure limite de souscription	18h
Date de création	18 mai 1993	Droits d'entrée max	4.0%
Durée de placement min. recommandée	Supérieure à 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	MSCI Europe ex UK (dividendes nets réinvestis)	Affectation des résultats	Capitalisation
		Ticker Bloomberg	NORWACT

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