Ofi Invest Inflation Euro HD

FR0011474956 C

Reporting mensuel au 31 octobre 2022

Valeur liquidative : 1 014,17 €

Actif net du fonds : 71 905 052 €

Évolution de la performance



(base 100 au 30 oct. 2017)

Performances cumulées

	1M	Ytd	1Y	3Y	5Y	8Y	10Y
Fonds	1,5%	7,4%	8,3%	11,4%	8,2%	5,9%	-
Indice de référence	-	-	-	-	-	-	-

Performances annuelles

	2016	2017	2018	2019	2020	2021
Fonds	0,4%	0,2%	-2,2%	-0,9%	-3,0%	6,3%
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 nets réinvestis. Le calcul de performance des indices composés de plusieurs indices est rebalancé tous les mois.

Principaux indicateurs

	Fonds	Indice de référence
Sensibilité	0,2	-
Max drawdown * (1)	-5,8	-
Délai de recouvrement * (1)	412	-
Rating moyen SII * * titres vifs obligataires, hors OPC.	BBB-	

	1Y	3Y	5Y
Ratio de Sharpe *	1,78	1,14	0,65
Ratio d'information *	-	-	-
Tracking error *	-	-	-
Volatilité fonds *	4,56	3,53	3,00
Volatilité indice *	-	-	-

* Source : Six Financial Information (1) sur 156 semaines (arrêté au dernier vendredi du mois)

Notation(s)

Six Financial Information

★★★★★

Date de création

27 mai 2013

Forme juridique

FCP de droit français

Devise

EUR (€)

Intensité carbone

Fonds	Indice
186,17	-

Couverture intensité carbone

Fonds	Indice
100,00%	-

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

Score ESG

Fonds	Indice
5,58	-

Couverture score ESG

Fonds	Indice
100,00%	-

Orientation de gestion

Le FCP est un nourricier de l'OPCVM Maître Ofi Invest Inflation Euro. Son objectif de gestion diffère de celui de l'OPCVM Maître dans la mesure où le FCP a recours aux marchés à terme pour couvrir son exposition au risque de taux. L'objectif de gestion de l'OPCVM Maître Ofi Invest Inflation Euro est "d'offrir une performance supérieure à celle de l'indicateur de référence JPM ELSI 1-10 ans, sur une durée de placement recommandée de deux ans, en tirant profit du potentiel d'appréciation des titres indexés sur l'inflation, essentiellement, des pays européens".

Indice de référence

-

Durée de placement minimum recommandée

Supérieure à 2 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)

Julien Rolland



Ugo Murciani

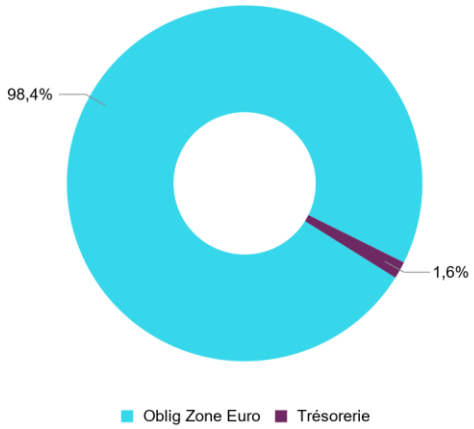


Ofi Invest Inflation Euro HD

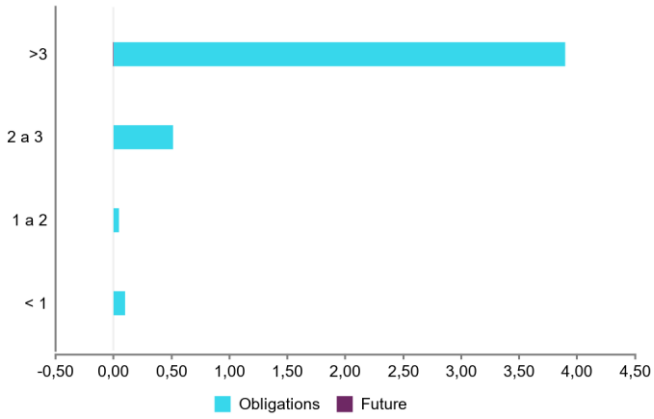
FR0011474956 C

Reporting mensuel au 31 octobre 2022

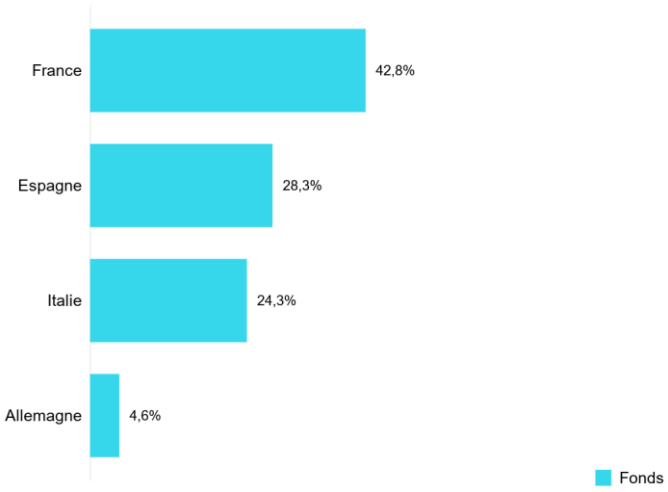
Répartition par type d'instrument



Contribution à la duration



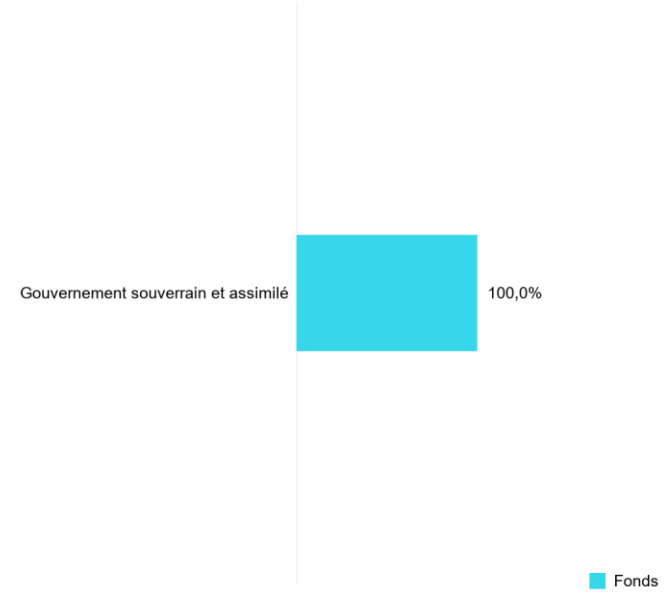
Répartition géographique (hors trésorerie)



Commentaire de gestion

Le portefeuille AI Inflation Euro HD est investi en totalité en parts d'OPCVM Aviva Investors Inflation Euro. A travers l'utilisation de contrats futures, la sensibilité aux taux réels du portefeuille a été maintenue à un niveau proche de zéro. Le fonds est exposé principalement aux variations des « point-morts » d'inflation (« break-even ») ainsi qu'aux évolutions du risque de crédit sur les dettes souveraines indexées.

Répartition sectorielle (hors trésorerie)

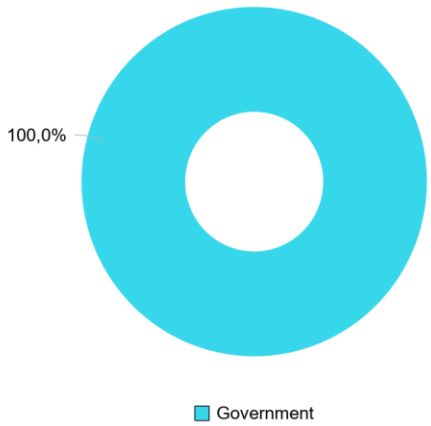


Ofi Invest Inflation Euro HD

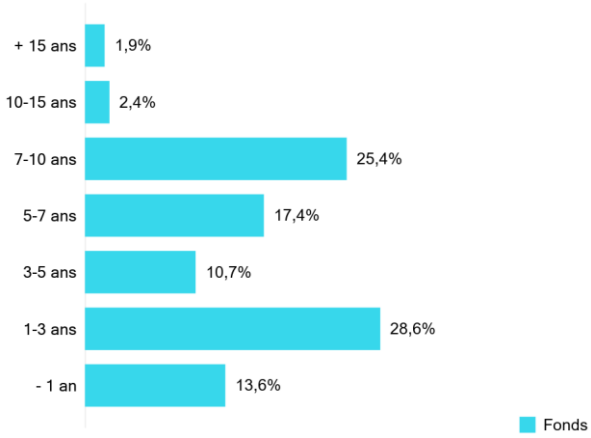
FR0011474956 C

Reporting mensuel au 31 octobre 2022

Répartition par type d'émetteur (hors trésorerie)



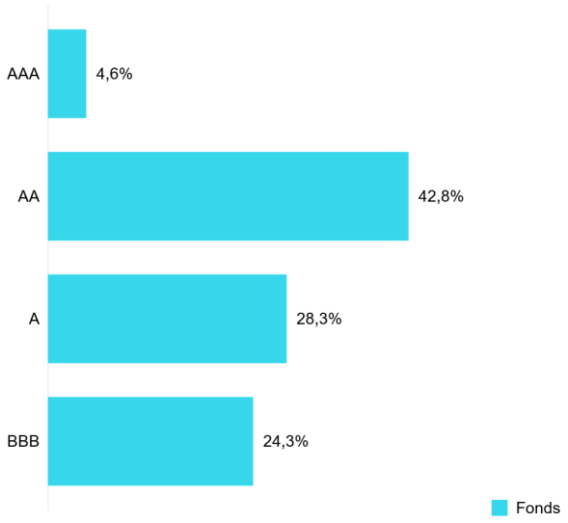
Répartition par maturité



Répartition par rang de subordination



Répartition par rating SII *



* Transparisation OPC, hors trésorerie.

5 principales lignes (hors dérivés)

SPAIN I/L BOND 1.8 11/2024 - 30/11/24	16,63%
FRANCE (REPUBLIC OF) 0.1 3/2025 - 01/03/25	7,31%
FRANCE (REPUBLIC OF) 2.1 7/2023 - 25/07/23	6,69%
FRANCE (REPUBLIC OF) 0.7 7/2030 - 25/07/30	5,24%
ITALY (REPUBLIC OF) CPTFEMU 0.65 5/2026 - 15/05/26	4,96%

5 principaux émetteurs (hors dérivés)

FRANCE (REPUBLIC OF)	42,1%
SPAIN (KINGDOM OF)	27,9%
ITALY (REPUBLIC OF)	20,0%
GERMANY (FEDERAL REPUBLIC OF)	4,5%
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO	4,0%

Répartition par devise



Nombre total d'émetteurs : -

Nombre total d'émissions : -

Ofi Invest Inflation Euro HD

FR0011474956 C

Reporting mensuel au 31 octobre 2022

Principales caractéristiques

Société de gestion	Abeille Asset Management	Dépositaire	Société Générale S.A.
Code ISIN	FR0011474956	Conservateur	Société Générale S.A.
Forme juridique	FCP de droit français	Heure limite de souscription	18h
Date de création	27 mai 2013	Droits d'entrée max	4.0%
Durée de placement min. recommandée	Supérieure à 2 ans	Frais de gestion max TTC	0,15%
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	PWC Audit
Indice de référence	-	Affectation des résultats	Capitalisation et/ou distribution
		Ticker Bloomberg	AVIEUHC

Définitions

La **WAM** est une mesure de la durée moyenne jusqu'à l'échéance de tous les titres détenus en portefeuille, pondérée pour refléter le poids relatif de chaque instrument, en considérant que l'échéance d'un instrument à taux variable est le temps restant à courir jusqu'à la prochaine révision de cet indice de taux, et non la maturité du titre.

La **WAL** est une mesure de la durée moyenne jusqu'à l'échéance de tous les titres détenus en portefeuille, pondérée pour refléter le poids relatif de chaque instrument, en considérant que l'échéance d'un instrument à taux variable est la maturité du titre.

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