OFI FUND - RS US EQUITY DYNAMIC MULTIFACTOR PART I USD

Reporting Mensuel - Actions - juin 2020

OFI Fund US Equity Dynamic Multifactor est un fonds investi en actions américaines de grandes capitalisations et vise une performance supérieure au S&P 500 sur un horizon de placement de 5 ans.
Au sein de l'univers des 500 plus grandes capitalisations américaines, l'équipe de gestion développe une stratégie systématique basée sur une allocation dynamique entre 4 facteurs de sélection de valeurs (taille, value, momentum et Low Vol). Conseil en investissement pour ce fonds, Koris International propose chaque trimestre aux gérants du fonds une allocation entre ces 4 facteurs.

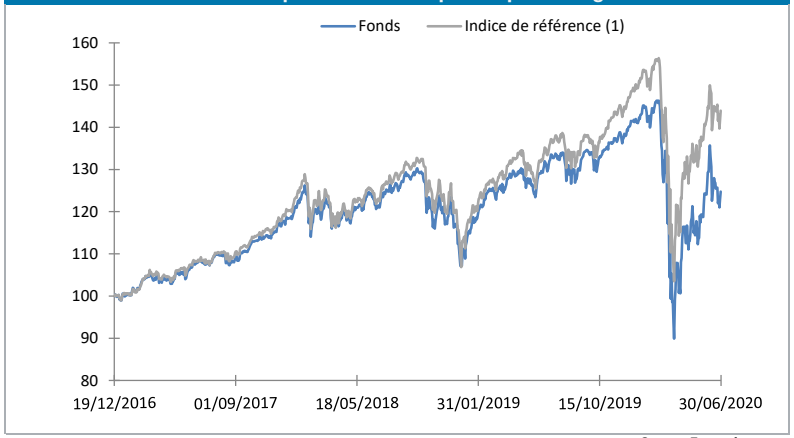
Chiffres clés au 30/06/2020

Valeur Liquidative (en USD) :	100,72
Actif net de la Part (en millions USD) :	51,34
Actif net Total des Parts (en millions USD) :	56,76
Nombre de lignes :	380
Nombre d'actions :	378
Taux d'exposition actions :	99,41%

Caractéristiques du fonds

Code ISIN :	LU0185280533
Ticker Bloomberg :	OFIDRUI LX Equity
Classification Europerformance :	Actions Amérique du Nord - Général
Indice de référence (1) :	S&P 500 NR
Principaux risques :	Pas de garantie en capital Risque lié aux marchés actions Risque de devises
Société de gestion :	OFI LUX
Société de gestion déléguée :	OFI ASSET MANAGEMENT
Analyste :	Stéphane YOUMBI - Olivier KERJAN
Forme juridique :	SICAV
Affectation du résultat :	Capitalisation
Devise :	USD
Date de changement de gestion :	19/12/2016
Horizon de placement :	Supérieur à 5 ans
Valorisation :	Quotidienne
Limite de souscription :	J à 12h
Limite de rachat :	J à 12h
Règlement :	J + 2
Commission de souscription :	Néant
Commission de rachat :	Néant
Commission de surperformance :	Néant
Frais courants :	0,88%
Dépositaire :	SOCIETE GENERALE BANK TRUST LUXEMBOURG
Valorisateur :	SOCIETE GENERALE SECURITIES SERVICES LUXEMBOURG

Evolution de la performance depuis reprise de gestion

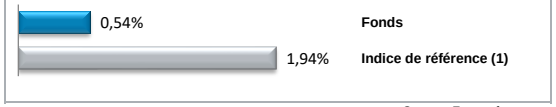


Source : Europerformance

Profil de risque

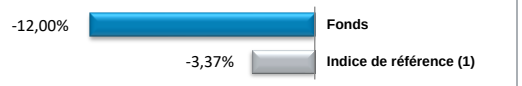
Niveau: 1 2 3 4 **5** 6 7

Performance sur le mois



Source : Europerformance

Performance depuis le début de l'année



Source : Europerformance

Performances & Volatilités

	Depuis réorientationde gestion		5 ans glissants		3 ans glissants		1 an glissant		Année 2020		6 mois	3 mois
	Perf.	*Volat.*	Perf.	*Volat.*	Perf.	*Volat.*	Perf.	*Volat.*	Perf.	*Volat.*	Perf.	Perf.
OFI FUND - RS US EQUITY DYNAMIC MULTIFACTOR PART I USD	24,75%	*23,06%*	-	-	-	-	-5,02%	*37,24%*	-12,00%	*52,97%*	-12,00%	17,94%
Indice de référence (1)	43,93%	*20,03%*	-	-	-	-	6,87%	*31,26%*	-3,37%	*44,08%*	-3,37%	20,37%

Source : Europerformance

Performances mensuelles

	Jan.	Fév.	Mars	Avr.	Mai	Juin	Juillet	Août	Sept.	Oct.	Nov.	Déc.	Année	*Indice*
2016												-1.04%*	-1,04%	*-1,00%*
2017	2,23%	3,35%	-0,37%	1,05%	1,53%	0,82%	1,75%	-0,51%	2,25%	2,07%	3,24%	0,62%	19,50%	*21,10%*
2018	5,00%	-3,67%	-1,04%	0,07%	1,76%	0,72%	3,39%	2,56%	0,37%	-7,79%	2,43%	-8,89%	-5,99%	*-4,94%*
2019	8,31%	3,74%	1,29%	2,95%	-5,26%	6,42%	1,11%	-1,94%	2,98%	0,44%	2,56%	2,63%	27,52%	*30,70%*
2020	-0,01%	-8,45%	-16,62%	12,41%	2,94%	-0,43%							-12,00%	*-3,37%*

**Performance du 19/12/2016 au 30/12/2016*

Source : Europerformance

(1) Indice de référence : S&P 500 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 Asset Management (22, rue Vernier 75017 Paris).

CONTACT • Département commercial • 01 40 68 17 17 • contact@ofi-am.fr

OFI Asset Management • Société de gestion de portefeuille agréée par l'AMF sous le numéro GP 92-12 • N° de TVA intra-communautaire : FR 51384940342 •
S.A à Conseil d'Administration au capital de 42 000 000 Euros • APE 6630Z 22 rue Vernier 75017 Paris •
Tél. : + 33 (0)1 40 68 17 17 • Fax : + 33 (0)1 40 68 17 18 • www.ofi-am.fr
@OFI_AM

OFI FUND - RS US EQUITY DYNAMIC MULTIFACTOR PART I USD

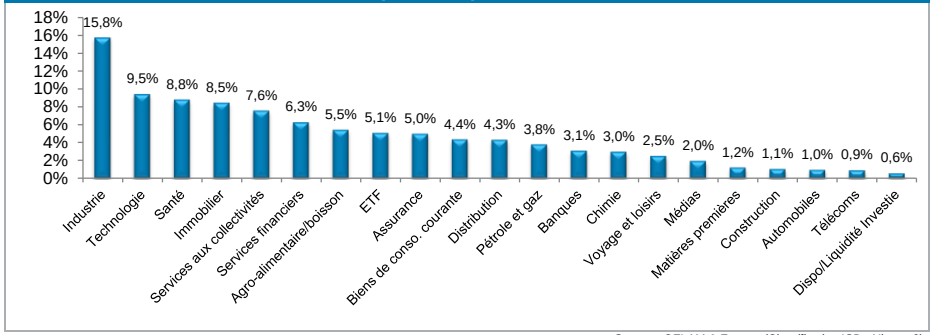
Reporting Mensuel - Actions - juin 2020

10 Principales Lignes *(hors liquidités)*

Libellé	Poids	Performances (2)	Contributions (2)	Pays	Secteur
INVESCO S P 500 UCITS ETF	5,10%	2,16%	0,11%	ETF	ETF
LINDE US	1,10%	4,83%	0,05%	Royaume-Uni	Chimie
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQTY	0,76%	5,55%	0,04%	Etats-Unis	Immobilier
NASDAQ	0,69%	0,85%	0,01%	Etats-Unis	Services financiers
DUKE REALTY	0,69%	2,64%	0,02%	Etats-Unis	Immobilier
KANSAS CITY SOUTHERN	0,68%	-0,82%	-0,01%	Etats-Unis	Industrie
QUEST DIAGNOSTICS	0,68%	-3,65%	-0,03%	Etats-Unis	Santé
LABORATORY CORP OF AMERICA	0,66%	-5,25%	-0,04%	Etats-Unis	Santé
MCCORMICK CO	0,62%	2,43%	0,01%	Etats-Unis	Agro-alimentaire/boisson
ARTHUR J GALLAGHER	0,58%	3,40%	0,02%	Etats-Unis	Assurance
TOTAL	**11,56%**		**0,19%**		

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

Répartition par secteur



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

3 Meilleures contributions sur le mois

Libellé	Poids	Performances (2)	Contributions (2)	Pays	Secteur
INVESCO S P 500 UCITS ETF	5,10%	2,16%	0,11%	ETF	ETF
LINDE US	1,10%	4,83%	0,05%	Royaume-Uni	Chimie
ADOBE SYSTEMS	0,44%	12,60%	0,05%	Etats-Unis	Technologie

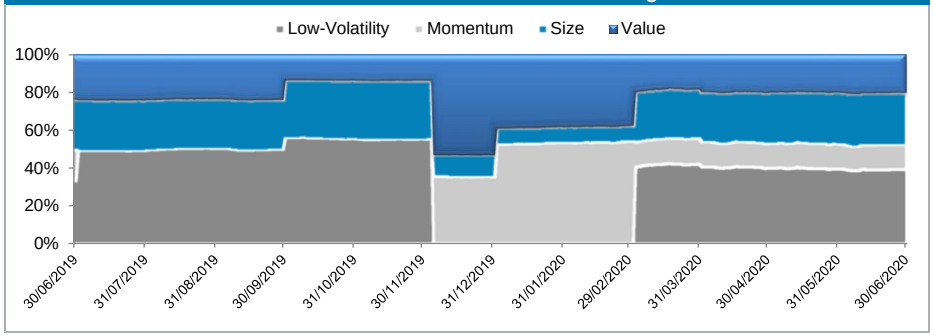
Source : OFI AM & Factset (Classification ICB - Niveau 2)

3 Moins bonnes contributions sur le mois

Libellé	Poids	Performances (2)	Contributions (2)	Pays	Secteur
COOPER COS	0,40%	-10,52%	-0,05%	Etats-Unis	Santé
HARRIS	0,24%	-14,93%	-0,04%	Etats-Unis	Technologie
SOUTHERN	0,39%	-9,15%	-0,04%	Etats-Unis	Services aux collectivités

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

Evolution de l'allocation factorielle sur 1 an glissant



Source : Koris

Principaux mouvements du mois

Achats / Renforcement

Libellé	Poids M-1	Poids M
ADOBE SYSTEMS	0,39%	0,44%
LINDE US	1,06%	1,10%
EQUIFAX	0,34%	0,38%
MICROSOFT	0,36%	0,40%
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQTY	0,73%	0,76%

Source : OFI AM

Ventes / Allègement

Libellé	Poids M-1	Poids M
INVESCO S P 500 UCITS ETF	5,26%	5,10%
COOPER COS	0,45%	0,40%
HARRIS	0,29%	0,24%
SOUTHERN	0,43%	0,39%
CME GROUP	0,35%	0,31%

Source : OFI AM

(2) Performances et contributions en devise de la part

Indicateurs statistiques

Bêta	Alpha	Tracking Error	Ratio de Sharpe (1)	Ratio d'Information	Fréquence de gain	Perte max.
1,18	-0,22	8,17%	-0,25	-1,46	54,90%	-35,83%

(1) Taux sans risque : EONIA *Source : Factset*

Données Financières

	PER 2020 (3)	PER 2021 (3)
Fonds	21,71	17,76

	PBV 2020 (4)	PBV 2021 (4)
Fonds	2,99	2,87

Source : 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 Asset Management (22, rue Vernier 75017 Paris).

CONTACT • Département commercial • 01 40 68 17 17 • contact@ofi-am.fr

OFI Asset Management • Société de gestion de portefeuille agréée par l'AMF sous le numéro GP 92-12 • N° de TVA intra-communautaire : FR 51384940342 •
S.A à Conseil d'Administration au capital de 42 000 000 Euros • APE 6630Z 22 rue Vernier 75017 Paris •
Tél. : + 33 (0)1 40 68 17 17 • Fax : + 33 (0)1 40 68 17 18 • www.ofi-am.fr

@OFI_AM