

# OFI FUND - US EQUITY DYNAMIC MULTIFACTOR PART I USD

Reporting Mensuel - Actions - août 2019



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.

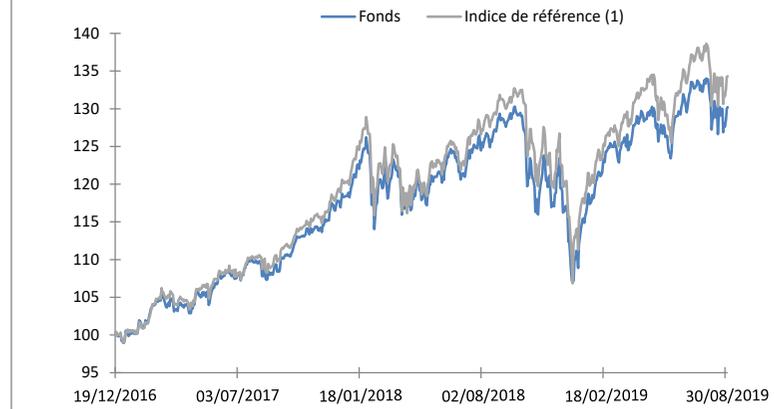
## Chiffres clés au 30/08/2019

|   |        |
|---|--------|
| Valeur Liquidative (en USD) :                 | 105,14 |
| Actif net de la Part (en millions USD) :      | 54,38  |
| Actif net Total des Parts (en millions USD) : | 65,18  |
| Nombre de lignes :                            | 350    |
| Nombre d'actions :                            | 348    |
| Taux d'exposition actions :                   | 99,56% |

## Caractéristiques du fonds

|                                      |   |
|--------------------------------------|---|
| Code ISIN :                          | LU0185280533  |
| Ticker:                              | OFIDRUI LX Equity   |
| Classification Europerformance :     | Actions Amérique du Nord - Général  |
| Indice de référence <sup>(1)</sup> : | S&P 500 NR  |
| Principaux risques :                 | Pas de garantie en capital<br>Risque lié aux marchés actions<br>Risque de devises |
| Société de gestion :                 | OFI LUX   |
| Société de gestion déléguée :        | OFI ASSET MANAGEMENT  |
| Analyste :                           | Stéphane YOUMBI - Michaël FAY   |
| 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 :                     | 0,86%   |
| 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

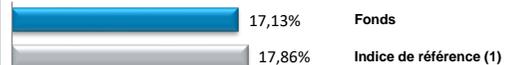
Niveau: 1 2 3 4 5 6 7

## Performance sur le mois



Source : Europerformance

## Performance depuis le début de l'année



Source : Europerformance

## Performances & Volatilités

|   | Depuis reorientation de gestion |        | 5 ans glissants |        | 3 ans glissants |        | 1 an glissant |        | Année 2019 |        | 6 mois | 3 mois |
|---|---------------------------------|--------|-----------------|--------|-----------------|--------|---------------|--------|------------|--------|--------|--------|
|   | Perf.                           | Volat. | Perf.           | Volat. | Perf.           | Volat. | Perf.         | Volat. | Perf.      | Volat. | Perf.  | Perf.  |
| OFI FUND - US EQUITY DYNAMIC MULTIFACTOR PART I USD | 30,22%                          | 12,79% | -               | -      | -               | -      | 1,16%         | 17,45% | 17,13%     | 12,20% | 4,24%  | 5,52%  |
| Indice de référence <sup>(1)</sup>                  | 34,31%                          | 14,90% | -               | -      | -               | -      | 2,30%         | 17,13% | 17,86%     | 12,80% | 5,83%  | 6,71%  |

Source : Europerformance

## Performances mensuelles

|             | Jan.  | Fév.   | Mars   | Avr.  | Mai    | Juin  | Juillet | Août   | Sept. | Oct.   | Nov.  | Déc.    | Année  | Indice |
|-------------|-------|--------|--------|-------|--------|-------|---------|--------|-------|--------|-------|---------|--------|--------|
| <b>2016</b> |       |        |        |       |        |       |         |        |       |        |       | -1,04%* | -1,04% | -1,00% |
| <b>2017</b> | 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% |
| <b>2018</b> | 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% |
| <b>2019</b> | 8,31% | 3,74%  | 1,29%  | 2,95% | -5,26% | 6,42% | 1,11%   | -1,94% |       |        |       |         | 17,13% | 17,86% |

\*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 FUND - US EQUITY DYNAMIC MULTIFACTOR PART I USD

Reporting Mensuel - Actions - août 2019

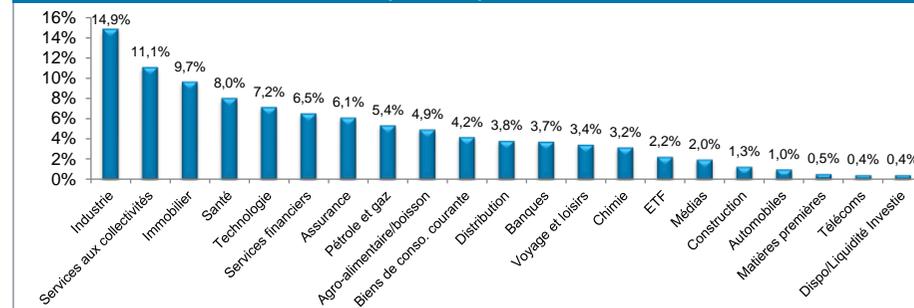


## 10 Principales Lignes (hors liquidités)

| Libellé                     | Poids        | Performances | Contributions | Pays       | Secteur                    |
|-----------------------------|--------------|--------------|---------------|------------|----------------------------|
| INVESCO S P 500 UCITS ETF   | 2,24%        | -2,80%       | -0,04%        | Etats-Unis | ETF                        |
| HARRIS                      | 1,18%        | 1,84%        | 0,02%         | Etats-Unis | Technologie                |
| AMERICAN WATER WORKS        | 0,77%        | 10,93%       | 0,07%         | Etats-Unis | Services aux collectivités |
| ENERGY                      | 0,76%        | 6,84%        | 0,05%         | Etats-Unis | Services aux collectivités |
| ESSEX PROPERTY TRUST        | 0,72%        | 6,30%        | 0,04%         | Etats-Unis | Immobilier                 |
| HARTFORD FINANCIAL SERVICES | 0,72%        | 1,13%        | 0,01%         | Etats-Unis | Assurance                  |
| CMS ENERGY                  | 0,71%        | 8,30%        | 0,05%         | Etats-Unis | Services aux collectivités |
| REPUBLIC SERVICES           | 0,70%        | 0,68%        | 0,00%         | Etats-Unis | Industrie                  |
| ARTHUR J GALLAGHER          | 0,69%        | 0,31%        | 0,00%         | Etats-Unis | Assurance                  |
| AMEREN                      | 0,69%        | 1,93%        | 0,01%         | Etats-Unis | Services aux collectivités |
| <b>TOTAL</b>                | <b>9,18%</b> |              | <b>0,23%</b>  |            |                            |

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 | Contributions | Pays       | Secteur                    |
|----------------------|-------|--------------|---------------|------------|----------------------------|
| AMERICAN WATER WORKS | 0,77% | 10,93%       | 0,07%         | Etats-Unis | Services aux collectivités |
| TYSON FOODS          | 0,38% | 17,03%       | 0,06%         | Etats-Unis | Agro-alimentaire/boisson   |
| CMS ENERGY           | 0,71% | 8,30%        | 0,05%         | Etats-Unis | Services aux collectivités |

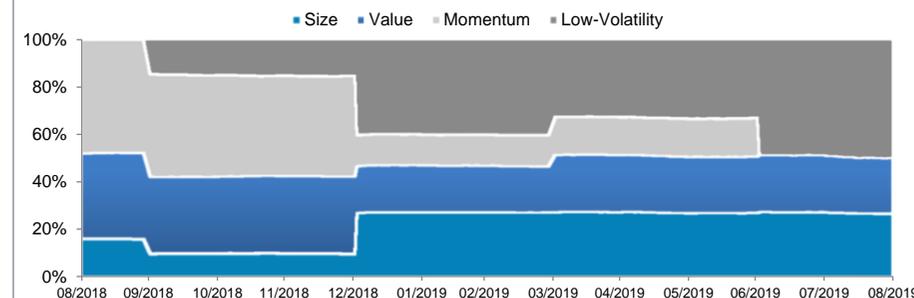
Source : OFI AM & Factset (Classification ICB - Niveau 2)

## 3 Moins bonnes contributions sur le mois

| Libellé                   | Poids | Performances | Contributions | Pays       | Secteur             |
|---------------------------|-------|--------------|---------------|------------|---------------------|
| INTL FLAVOR AND FRAGRANCE | 0,40% | -23,78%      | -0,12%        | Etats-Unis | Chimie              |
| DXC TECHNOLOGY            | 0,11% | -40,43%      | -0,07%        | Etats-Unis | Technologie         |
| FRANKLIN RESOURCES        | 0,30% | -19,46%      | -0,07%        | Etats-Unis | Services financiers |

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 |
| GLOBE LIFE                | Achat     | 0,48%   |
| INVESCO S P 500 UCITS ETF | 1,27%     | 2,24%   |

Source : OFI AM

| Ventes / Allègement |           |         |
|---------------------|-----------|---------|
| Libellé             | Poids M-1 | Poids M |
| TORCHMARK           | 0,49%     | Vente   |

Source : OFI AM

## Indicateurs statistiques

| Bêta | Alpha | Tracking Error | Ratio de Sharpe <sup>(1)</sup> | Ratio d'Information | Fréquence de gain | Perte max. |
|------|-------|----------------|--------------------------------|---------------------|-------------------|------------|
| 1,00 | -0,02 | 3,36%          | 0,40                           | -0,33               | 53,85%            | -17,74%    |

(1) Taux sans risque : EONIA

Source : Factset

## Données Financières

| Fonds | PER 2019 (3) | PER 2020 (3) | Fonds | PBV 2019 (4) | PBV 2020 (4) |
|-------|--------------|--------------|-------|--------------|--------------|
|       | 18,10        | 16,71        |       | 2,84         | 2,66         |

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

