OFI FUND - US EQUITY DYNAMIC MULTIFACTOR PART I EUR

Reporting Mensuel - Actions - septembre 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.

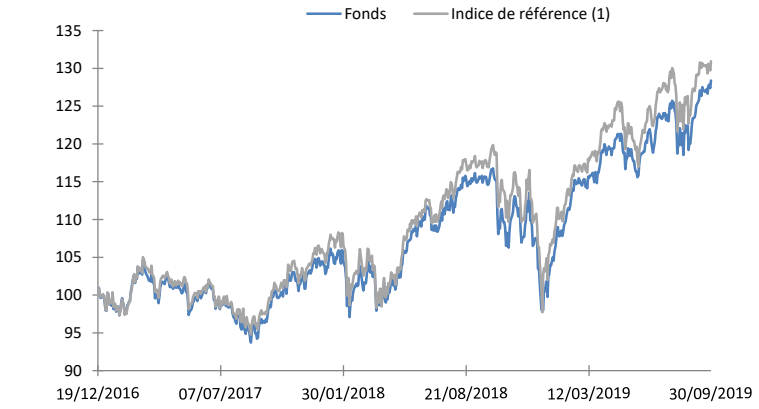
Chiffres clés au 30/09/2019

Valeur Liquidative (en euros) :	105,21
Actif net de la Part (en millions d'euros) :	3,11
Actif net Total des Parts (en millions d'euros) :	61,00
Nombre de lignes :	351
Nombre d'actions :	349
Taux d'exposition actions :	99,36%

Caractéristiques du fonds

Code ISIN:	LU0185280459
Ticker:	OFIRUQI LX Equity
Classification Europerformance :	Actions Amérique du Nord - Général
Indice de référence [1] :	S&P 500 NR (en EUR)
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/Gérant :	Stéphane YOUMBI - Michaël FAY
Forme juridique :	SICAV
Affectation du résultat :	Capitalisation
Devise :	EUR
Date de reprise 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 :	0,85%
Dépositaire :	SOCIETE GENERALE BANK TRUST LUXEMBOURG
Valorisateur :	SOCIETE GENERALE SECURITIES SERVICES LUXEMBOURG

Evolution de la performance depuis reprise de gestion

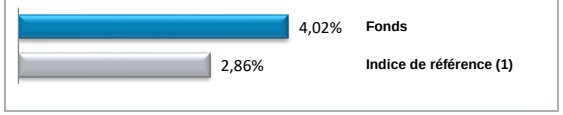


Source : Europerformance

Profil de risque

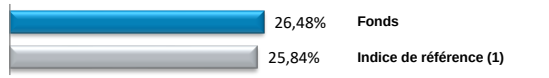
Niveau: 1 2 3 4 5 **6** 7

Performance sur le mois



Source : Europerformance

Performance depuis le début de l'année



Source : Europerformance

Performances & Volatilités

	Depuis réorientation de gestion		3 ans glissants		1 an glissant		Année 2019		6 mois	3 mois
	Perf.	***Volat.***	**Perf.**	***Volat.***	**Perf.**	***Volat.***	**Perf.**	***Volat.***	**Perf.**	**Perf.**
OFI FUND - US EQUITY DYNAMIC MULTIFACTOR PART I EUR	28,38%	*13,97%*	-	-	10,60%	*17,96%*	26,48%	*11,51%*	9,16%	6,66%
Indice de référence [1]	30,93%	*16,32%*	-	-	10,40%	*17,87%*	25,84%	*12,25%*	8,93%	6,07%

Source : Europerformance

Performances mensuelles

	Jan.	Fév.	Mars	Avr.	Mai	Juin	Juillet	Août	Sept.	Oct.	Nov.	Déc.	Année	*Indice*
2016												-2.07%*	-2,07%	*-2,04%*
2017	-0,22%	5,11%	-1,01%	-0,76%	-1,67%	-0,60%	-1,57%	-1,35%	2,83%	3,58%	0,86%	-0,07%	4,97%	*6,37%*
2018	1,20%	-1,61%	-1,87%	1,87%	5,32%	0,70%	3,16%	3,14%	0,54%	-5,48%	2,50%	-9,75%	-1,26%	*-0,15%*
2019	7,91%	4,53%	2,72%	3,15%	-4,72%	4,13%	3,43%	-0,86%	4,02%				26,48%	*25,84%*

**Performance du 19-12-2016 au 31-12-2016*

Source : Europerformance

(1) Indice de référence : S&P 500 NR (en EUR)

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 - US EQUITY DYNAMIC MULTIFACTOR PART I EUR

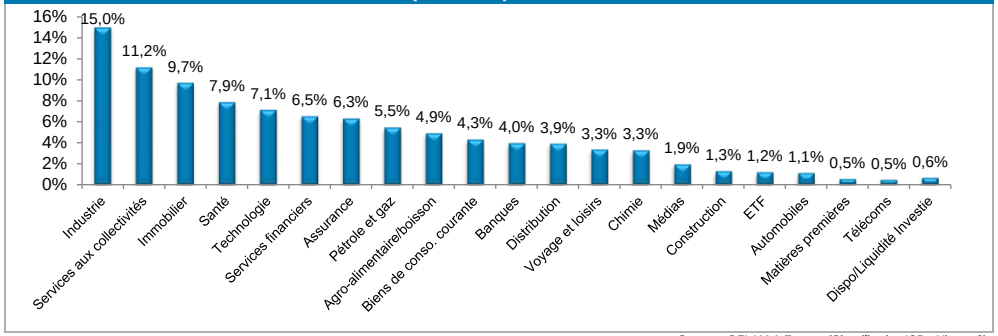
Reporting Mensuel - Actions - septembre 2019

10 Principales Lignes *(hors liquidités)*

Libellé	Poids	Performances (2)	Contributions (2)	Pays	Secteur
INVESCO S P 500 UCITS ETF	1,18%	3,09%	0,07%	Etats-Unis	ETF
HARRIS	1,14%	-0,31%	0,00%	Etats-Unis	Technologie
ENTERGY	0,77%	5,06%	0,04%	Etats-Unis	Services aux collectivités
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	0,73%	5,05%	0,04%	Etats-Unis	Assurance
AMERICAN WATER WORKS	0,73%	-1,44%	-0,01%	Etats-Unis	Services aux collectivités
ESSEX PROPERTY TRUST	0,72%	2,71%	0,02%	Etats-Unis	Immobilier
CMS ENERGY	0,70%	2,46%	0,02%	Etats-Unis	Services aux collectivités
AMEREN	0,70%	4,81%	0,03%	Etats-Unis	Services aux collectivités
LINDE US	0,69%	3,59%	0,02%	Etats-Unis	Chimie
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQTY	0,67%	3,84%	0,03%	Etats-Unis	Immobilier
TOTAL	**8,05%**		**0,25%**		

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

Répartition par secteur



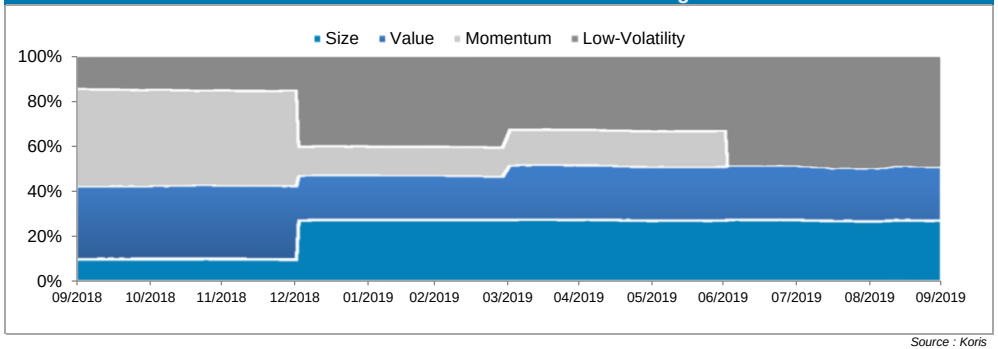
Source : OFI AM & Factset (Classification ICB - Niveau 2)

3 Meilleures contributions sur le mois

Libellé	Poids	Performances (2)	Contributions (2)	Pays	Secteur
INVESCO S P 500 UCITS ETF	1,18%	3,09%	0,07%	Etats-Unis	ETF
BB AND T	0,46%	13,14%	0,06%	Etats-Unis	Banques
LYONDELLBASELL INDUSTRIES	0,37%	16,80%	0,05%	Etats-Unis	Chimie

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

Evolution de l'allocation factorielle sur 1 an glissant



Source : Koris

3 Moins bonnes contributions sur le mois

Libellé	Poids	Performances (2)	Contributions (2)	Pays	Secteur
CHURCH AND DWIGHT	0,51%	-4,73%	-0,03%	Etats-Unis	Biens de conso. courante
TYSON FOODS	0,35%	-6,48%	-0,02%	Etats-Unis	Agro-alimentaire/boisson
STARBUCKS	0,29%	-7,50%	-0,02%	Etats-Unis	Voyage et loisirs

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

Principaux mouvements du mois

Achats / Renforcements

Libellé	Poids M-1	Poids M

Source : OFI AM

Ventes / Allègements

Libellé	Poids M-1	Poids M
INVESCO S P 500 UCITS ETF	2,24%	1,18%

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.
0,99	0,02	3,04%	0,59	0,32	58,82%	-15,00%

(1) Taux sans risque : EONIA

Source : Europerformance

Données Financières

	PER 2019 (3)	PER 2020 (3)
Fonds	19,00	17,24

(3) Price Earning Ratio = Cours / Bénéfice Net par Action anticipé

	PBV 2019 (4)	PBV 2020 (4)
Fonds	2,89	2,77

(4) Price to Book Value = Cours / Actif Net

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