



L'investissement factoriel selon Evli : De la théorie à la pratique

COMMUNIQUE DE PRESSE | Paris, le 06.03.2018

Peter Lindahl, Gérant Senior, Antti Sivonen, Gérant, et Mattias Lagerspetz, Gérant, ont produit un dossier entièrement consacré à l'investissement factoriel, de ses fondations théoriques à ses applications pratiques.

Factor investing : de quoi parle-t-on ?

Par essence, l'investissement factoriel concerne la diversification des sources de rendement. Alors que les détenteurs de portefeuilles traditionnels diversifient leurs positions à travers plusieurs classes d'actifs et un certain nombre de titres, les investisseurs factoriels améliorent la diversification de leur portefeuille et le rendement ajusté du risque grâce aux facteurs qui offrent des sources alternatives de rendement. Le fait que les facteurs soient des styles d'investissement performants se démontre sur le long-terme. Cependant, tous les styles d'investissement ne sont pas des facteurs.

L'intégralité du dossier est disponible [ici](#) et deux livres blancs permettent d'approfondir le sujet :

- [The case for equity factors](#)
- [Factor investing accross asset classes](#)

Le premier offre un aperçu du contenu universitaire consacré à l'investissement factoriel et aux différents facteurs. Il propose d'examiner la surperformance et explore des solutions concrètes.

Le second part du constat que les facteurs permettent la meilleure diversification quand ils sont exercés à travers toutes les classes d'actifs parce que les facteurs existent également sur les marchés obligataires, devises et matières premières.

Mise en pratique : création d'un portefeuille low carbon

En 2015, EVLI s'est associé à l'EDHEC - Risk Institute Scientific Beta pour créer un fonds offrant des rendements liés aux facteurs. Depuis, ERI Scientific Beta a construit des indices low-carbon, en excluant les titres des sociétés émettrices de fort taux de carbone, qui ont démontré leur performance au même titre que les autres investissements factoriels. Depuis début 2017, les fonds d'EVLI suivent un indice factoriel low carbon développé sur-mesure.

Concernant le fonds EVLI Equity Factor Europe Fund, son processus d'investissement systématique (exclusion des sociétés les plus émettrices de CO², sélection de valeurs selon les facteurs, diversification et allocation factorielle) a ainsi permis une diminution de l'empreinte carbone du portefeuille de plus de 60%.

Pour en savoir plus sur l'investissement factoriel low carbon : <https://blog.evli.com/funds-hub/factor-investing/low-carbon-investing-for-a-better-future>

A propos d'Evli Fund Management Company Ltd :

Evli Fund Management Company Ltd est une société de gestion scandinave qui cible particulièrement les investisseurs institutionnels et propose une gestion active avec une coloration ESG, dans une perspective long-terme. Les gérants Senior ont tous une ancienneté de 10 ans en moyenne dans l'entreprise et disposent chacun d'une vingtaine d'année d'expérience dans ce secteur.

Evli gère au total de 11,2 milliards d'euros d'encours pour le compte de ses clients (net 12/2017). Les fonds propres du groupe Evli s'élèvent à 72,5 millions d'euros et son ratio de solvabilité BIS est de 15,0% (31 Décembre 2017). La société compte plus de 200 employés. Les parts B d'Evli Bank Plc sont cotées sur le Nasdaq Helsinki Ltd.

Contact presse :

Agence BdandP

Céline Bruggeman

01 76 21 81 12

cbruggeman@bdandp.com