



Evli fête les 3 ans de sa stratégie d'investissement factoriel

COMMUNIQUE DE PRESSE | Paris, le 03.12.2018

En octobre 2018, le fonds Evli Equity Factor Investing fêtait ses 3 ans. L'occasion pour la société de gestion finlandaise Evli de revenir sur le développement de sa stratégie d'investissement factoriel, notamment dans une perspective d'investissement responsable.

En 2015, Evli s'est associé à l'EDHEC - Risk Institute Scientific Beta pour créer un fonds offrant des rendements liés aux facteurs. Le fonds Evli Equity Factor Investing est ainsi basé sur l'indice ERI Scientific Beta qui suit quatre facteurs déterminés de manière académique : la valeur, le low risk, le momentum et la qualité. L'objectif de cette stratégie est d'améliorer la diversification du portefeuille et le rendement ajusté du risque grâce aux facteurs qui offrent des sources alternatives de rendement.

Evli Equity Factor Europe, géré par Mattias Lagerspetz, Peter Lindahl et Antti Sivonen, se concentre ainsi sur les actions de grandes sociétés européennes selon un style de gestion active. Le fonds n'est soumis à aucune restriction concernant le secteur d'activité ou les pays européens dans lesquels les entreprises sont installées. De plus, chez Evli, cette recherche de rendement via une stratégie d'investissement factoriel s'inscrit dans la perspective plus large de l'investissement responsable.

Investissement factoriel et Low Carbon :

Depuis début 2017, les fonds d'EVLI suivent un indice factoriel *Low Carbon* développé sur-mesure par ERI Scientific Beta, en excluant les titres des sociétés émettrices de fort taux de carbone. Ainsi, le filtre *Low Carbon* est ajouté en amont dans la sélection des sociétés qui seront par la suite intégrées dans le processus d'investissement factoriel.

Cette démarche appliquée au fonds Evli Equity Factor Europe permet donc d'allier rendement et investissement responsable et réduire ainsi l'empreinte carbone des investissements pour les investisseurs institutionnels. *« L'investissement factoriel Low Carbon combine les avantages du factor investing et la prise en considération des risques liés au changement climatique de manière très efficace en termes de coûts. Les performances du fonds Evli Equity Factor Europe soulignent que l'on peut être écologiquement responsable sans frais supplémentaires. »*, souligne Petter von Bondsdorff, Directeur du développement d'Evli.

Evli Equity Factor Europe est noté 4 étoiles par Morningstar et connaît une performance de 14,25% depuis son lancement au 31 octobre 2015 contre 10,76% pour son indice de référence sur la même période.

Caractéristiques techniques du fonds :

Type de fonds : UCITS

ISIN A/B/IB : FI4000153804/FI4000153820/FI4000153838

Benchmark : MSCI Europe TR Net (EUR)

Frais de Gestion : 0.95% p.a. (A, B) / 0.65% p.a. (IA, IB)

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 12,3 milliards d'euros d'encours pour le compte de ses clients (net 9/2018). Les fonds propres du groupe Evli s'élèvent à 74,3 millions d'euros et son ratio de solvabilité BIS est de 15,3% (30 septembre 2018). La société compte plus de 250 employés. Les parts B d'Evli Bank Plc sont cotées sur le Nasdaq Helsinki Ltd.

Contact presse :

Agence BDandP

Céline Bruggeman / Justine Gloaguen

01 76 21 81 12 / 01 76 21 81 13

cbruggeman@bdandp.com

jgloaguen@bdandp.com