



## La stratégie d'investissement factoriel d'Evli devient complètement ESG compatible

COMMUNIQUE DE PRESSE | Paris, le 30.09.2019

**A travers sa stratégie d'investissement factoriel, la société de gestion finlandaise propose grâce à l'intégration complète des critères ESG au sein du processus d'investissement des fonds Evli Equity Factor Europe et Evli Equity Factor USA une approche plus efficiente en termes d'investissement responsable.**

### L'investissement factoriel chez Evli

Lancée en 2015, la stratégie d'investissement factoriel d'Evli vise à améliorer la diversification de ses portefeuilles et leur rendement ajusté du risque grâce aux facteurs qui offrent des sources alternatives de rendement. « *Nous nous appuyons sur quatre facteurs déterminés de manière académique : la valeur, le low risk, le momentum et la qualité* », rappelle Peter Lindahl, Senior Portfolio Manager et Head of Systematic Funds chez Evli. « *Nous nous concentrons ensuite principalement sur les actions de sociétés européennes et américaines en utilisant un processus factoriel systématique* ». L'investissement factoriel permet ainsi de combiner le potentiel de rendement de la gestion active avec des coûts de gestion proches de ceux de la gestion passive.

### Une stratégie factorielle compatible avec l'investissement responsable

Dès le départ, Evli souhaitait inscrire sa stratégie d'investissement factoriel dans une approche d'investissement responsable. Les fonds factoriels d'Evli ont introduit un filtre « Low Carbon » en 2017, mais la société de gestion souhaite aujourd'hui aller plus loin et intégrer complètement les critères ESG à son processus d'investissement factoriel. « *En amont de notre sélection de titres qui seront par la suite intégrés aux facteurs qui composent nos portefeuilles, nous ajoutons des filtres ESG selon une approche Best-in-class et d'exclusion des sociétés du secteur de l'alcool, de l'armement, du tabac, des paris, du divertissement pour adultes et du charbon ainsi que les sociétés qui ne respectent pas les principes du Global Compact de l'ONU selon les analyses du MSCI ESG Research* », explique Peter Lindahl.

Cette démarche appliquée aux fonds Evli Equity Factor Europe et Evli Equity Factor USA permet donc aux investisseurs institutionnels d'allier rendement et investissement responsable. « *Les performances de nos fonds factoriels soulignent justement que l'on peut être écologiquement et socialement responsable sans frais supplémentaires.* », conclue Petter von Bondsdorff, Partner et Directeur du développement International d'Evli.

### Caractéristiques techniques des fonds

#### Evli Equity Factor Europe

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)

## **Evli Equity Factor USA**

Type de fonds : UCITS

ISIN A/B/IB : FI4000210802/FI4000210810/FI4000210836

Benchmark : MSCI USA TR Net (USD)

Frais de Gestion : 0.95% p.a. (B)

### **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 13,3 milliards d'euros d'encours pour le compte de ses clients (net 06/2019). Les fonds propres du groupe Evli s'élèvent à 69,6 millions d'euros et son ratio de solvabilité BIS est de 14,7% (30 juin 2019). La société compte plus de 260 employés. Les parts B d'Evli Bank Plc sont cotées sur le Nasdaq Helsinki Ltd.

### **Contact presse :**

Agence BDandP

Justine Gloaguen / Céline Bruggeman

01 76 21 81 13

[jgloaguen@bdandp.com](mailto:jgloaguen@bdandp.com)

[cbruggeman@bdandp.com](mailto:cbruggeman@bdandp.com)