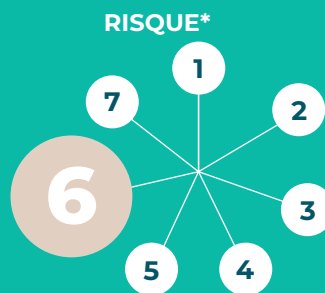


ECOFI IA RESPONSABLE

Ecofi IA Responsable est un fonds actions ISR internationales qui associe l'analyse Environnementale, Sociale et de Gouvernance avec l'intelligence artificielle



LE PROFIL DU FONDS

Ecofi IA Responsable en bref...

- Un fonds ISR¹ actions internationales investi dans des valeurs issues d'un processus statistique de sélection fondé sur l'intelligence artificielle
- Rechercher une performance supérieure à l'indice Stoxx 600

L'intelligence artificielle, cœur de la stratégie d'investissement

Intégrer l'intelligence artificielle dans sa gestion permet d'analyser un plus grand nombre de données et de pouvoir détecter les meilleurs profils d'investissement.

Ecofi IA Responsable se caractérise par une gestion fondée sur un processus statistique de construction de portefeuille développé par ADVESTIS (Label Fintech Innovante de Finance Innovation 2016) s'appuyant sur l'analyse des enjeux Environnementaux, Sociaux et de Gouvernance (ESG).

Ecofi collabore depuis 2013 avec ADVESTIS, la gestion mise en place a fait l'objet de nombreuses récompenses. Le modèle est aujourd'hui décliné sur la gestion actions avec Ecofi IA Responsable.

Ainsi, au sein d'un univers d'investissement ISR préalablement filtré, le modèle algorithmique construit un portefeuille basé sur des valeurs ayant le plus fort potentiel de surperformance par rapport à l'indice pour les trois prochains mois.

Un modèle de gestion quantitatif éprouvé

Le portefeuille est géré selon un processus statistique permettant d'identifier les valeurs ayant le plus de potentialité de surperformer Stoxx 600.

Le paramétrage de l'algorithme (règles d'association), le choix des variables et l'optimisation des critères de sélection, sont fondamentaux. Ainsi, l'algorithme ajuste régulièrement ses règles en fonction de l'environnement des marchés financiers dont l'évolution est permanente.

L'algorithme, préalablement calibré sur des données historiques, permet de sélectionner les actions dont le profil dégage une performance récurrente et dont le couple rendement/risque est le plus attractif.

Un univers d'investissement ISR

Le filtre ISR s'applique sur l'univers initial monde noté par l'agence d'analyse extra-financière Vigeo Eiris.

L'intégration des critères ESG dans la gestion permet d'encourager la prise en compte de ces enjeux et d'approfondir la connaissance des investissements pour une meilleure maîtrise des risques.

Investir dans Ecofi IA Responsable c'est bénéficier de l'intelligence artificielle couplée à la prise en compte des enjeux ESG.



Appliquer l'Intelligence Artificielle à la gestion d'actifs, c'est multiplier la capacité d'analyse des données. Réconcilier la performance financière et extra-financière est l'un des enjeux d'une gestion responsable ; grâce à l'IA, construire un portefeuille optimal ayant cette double dimension est devenu une réalité."

Olivier Guillou,
Directeur de la Gestion

* L'indicateur synthétique de risque est basé sur la volatilité historique du portefeuille au cours des 5 dernières années. Le fonds est classé dans la catégorie 6 en raison de son exposition discrétionnaire au marché actions. Son profil rendement / risque est élevé.

¹Fonds ISR selon la méthodologie Ecofi, ce fonds ne dispose pas du label ISR d'Etat

PROCESSUS D'INVESTISSEMENT

1 Sélection de l'univers d'investissement

- ▶ **Univers initial** : actions internationales
- ▶ **Filtres ISR** :
 - Exclusions sectorielles (armements controversés, tabac, jeux, charbon) et des paradis fiscaux ;
 - Sélection des émetteurs au regard de leur performance ESG (Vigeo Eiris) et selon la Méthode I-Score ;
 - Gestion des sociétés controversées.

2 Sélection des valeurs à plus fort potentiel

- ▶ Sélection des valeurs en fonction d'un algorithme statistique fondé sur l'intelligence artificielle (méthode de règles d'association) visant à surperformer l'indice de référence
 - Attribution d'une espérance de performance relative par action
 - Sélection des valeurs avec une espérance suffisamment élevée

3 Construction du portefeuille

- ▶ Optimisation des pondérations pas actions sous contraintes de la note algorithmique utilisée dans le processus de sélection

LA GESTION ET LE SUIVI DU RISQUE

- Le calcul du risque combine des facteurs de volatilité et de liquidité.

EN SAVOIR + SUR ADVESTIS

Advestis, entreprise d'investissement fondée en 2011 est un "pure player" de l'Intelligence Artificielle et du Machine Learning. Christophe Geissler, CEO fondateur, et ancien élève de l'Ecole Normale Supérieure de Paris, est à la tête d'une équipe de chercheurs de haut niveau. Advestis conseille aujourd'hui plus d'1,2 Md€ d'actifs. Ses travaux lui ont valu le Label Fintech Innovante de Finance Innovation en 2016 et a permis à Ecofi Investissements d'obtenir le Lipper Fund Awards pour Ecofi Quant Obligations dans la catégorie « Bond EMU Government LT » sur 5 ans.



Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures.

+ AVANTAGES

- L'expertise de notre partenaire Advestis en gestion quantitative
- Un filtre ISR rigoureux
- Un modèle innovant

! INCONVÉNIENTS ET RISQUES

- Risque action, perte en capital
- Risque de gestion discrétionnaire
- Risque lié à l'utilisation du processus statistique d'allocation
- Risque lié aux petites et moyennes capitalisations, risque de taux, crédit, change, durabilité

CARACTÉRISTIQUES

Classification AMF : Actions internationales
Code ISIN : part C : FR0013417565 - Part I : FR0013417557 - Part F : FR0013417540
Forme juridique : UCITS IV
Dépositaire / Conservateur : Caceis Bank France
Valorisateur : Caceis Fund Administration
Société de gestion : Ecofi
Date de création : 5 juin 2019
Devise de valorisation : Euro
Zone géographique : International
Indice de référence : Stoxx 600.
La gestion financière du FCP ne vise pas à répliquer cet indice,

le FCP n'étant ni indiciel ni à référence indicelle. Cet indice permet à l'investisseur d'appréhender la performance et le risque qu'il peut attendre de son investissement dans le FCP.

Conditions de souscriptions/rachats : Chaque jour (J) avant 11h30 sur la valeur liquidative du jour (J) - Règlement J+1

Valeur initiale de la part : Action C : 100 euros - Action I/F : 10 000 euros. La souscription de parts F sera fermée à partir du 12 janvier 2022.

Frais de gestion : Part C : 1,60% - Part I : 0,80% - Part F : 0,50% (les frais sont TTC sur l'actif net.)

Commission de souscription : Non acquise : 3% TTC (max.) de la VL x le nombre de parts (Les allers-retours sont exonérés) - Néant pour les parts C / Acquises : néant

Commission de rachat/mouvement : Néant

Commission de surperformance : Part F : 15% TTC de la performance supérieure à l'indicateur de référence - Part I/C : Néant

CONTACT : +33 (1) 44 88 39 00 - contact@ecofi.fr

Document non contractuel. Le présent document ne constitue pas une recommandation d'investissement personnalisée.

Conformément à la réglementation, toute souscription devra être précédée d'une évaluation de l'expérience, de la situation et des objectifs du Client. Il est recommandé, avant tout investissement, de lire attentivement le prospectus complet (et en particulier le Document d'Information Clé pour l'Investisseur ou DICI) de l'OPC. Les documents d'informations périodiques des OPC sont tenus en permanence à votre disposition chez Ecofi Investissements 22 rue Joubert - 75009 Paris ou sur notre site internet www.ecofi.fr. Ecofi Investissements est susceptible de détenir des liens d'intérêt (notamment gestionnaire ou distributeur) ou de détenir des positions sur les OPC ou les valeurs mentionnées. Une quote-part des frais de fonctionnement et de gestion peut-être éventuellement attribuée à un tiers distributeur afin de rémunérer l'acte de commercialisation dudit OPC. Ecofi Investissements est agréée par l'AMF (<http://www.amf-france.org/>) sous le n°GP97004 en date du 07/02/1997.