

 - UE -

amLeague crée un fonds avec l'indice Low Beta Europe pour référence

Jean-François Tardiveau 17/02/2015

L'Autorité des marchés financiers (AMF) a dit oui. Après l'agrément du régulateur, amLeague vient d'annoncer la création du FCP Fédéral amLeague Low Beta Europe. Ce fonds UCITS, opéré par la société de gestion Fédéral Finance Gestion, vise à répliquer le « amLeague Low Beta Europe Index », l'indice de référence lancé en juin 2012 par la plateforme. L'indicateur en question, dont amLeague est l'administrateur et l'agent de calcul, repose sur l'agrégation des trois comptes notionnels des sociétés de gestion du profil «Actions Europe Equity » qui présentent le plus faible beta de portefeuille sur 6 mois. Chaque trimestre, une révision est opérée. Ce lancement vient concrétiser le système consistant à faire "implémenter, par une société de gestion agissant en tant que répliqueur indiciel, les capacités de gestion financière de sociétés participant à la plateforme « Same Level Playing Field » (100% transparent, 100% comparable) d'amLeague, indique un communiqué d'amLeague.

Les investisseurs vont donc pouvoir investir sur l'OPCVM qui, en pratique, est composé d'Ossiam, Tobam, et SwissLife Asset Managers. Par rapport au mois précédent, le rebalancement intervenu le 30 janvier a laissé la composition du portefeuille inchangée (lire Newsmanagers du 22 janvier 2015). En termes de résultats, depuis le début de l'année marqué par une forte progression des marchés, l'indice affiche une performance de 8,63 % contre 8,72 % pour l'indice Stoxx 600. En revanche, depuis la création de l'indice d'amLeague, à la mi-2012, ce dernier a progressé de 43,03 % contre 36,93 % pour la référence européenne.

A noter enfin que les premières souscriptions, émanant d'investisseurs institutionnels, interviendront le 27 février.

Caractéristiques :

Code Isin : FR0012420461

Montant minimum.à la souscription : 100 000 euros

Valeur liquidative d'origine : 100 000 euros

Fractionnement : Oui en millièmes

Frais de gestion : 1 % TTC max.