

Paris, le 26 décembre 2023

ECOFI OPTIM VARIANCE

Remplacement de l'administrateur d'indices STOXX par l'administrateur d'indices FCI - 01 janvier 2024

Mesdames, Messieurs,

Nous vous informons qu'ECOFI Investissements a décidé de remplacer l'administrateur d'indices STOXX par l'administrateur d'indices FAIR COST INDEX (FCI).

Par conséquent, l'objectif de gestion, l'indice de référence ainsi que l'univers initial d'investissement du fonds dénommé ECOFI OPTIM VARIANCE évoluent pour tenir compte de ce changement.

A compter du 01 janvier 2024, l'objectif du fonds sera de réaliser, sur l'horizon de placement recommandé (5 ans) et selon une approche ISR, une performance équivalente à celle de l'indice FCI EMU 50 (au lieu de l'EURO STOXX 50), avec une volatilité annualisée inférieure à 80% de celle de cet indice.

L'indice de référence EURO STOXX 50 sera remplacé par l'indice FCI EMU 50 (code Bloomberg : FCIEMU5N) qui mesure la performance du marché de la zone Euro des grandes et moyennes capitalisations sur la base d'un panier de 50 émetteurs. Il est calculé et publié par le fournisseur d'indices internationaux Fair Cost Index (FCI). L'administrateur FCI est inscrit sur le registre d'administrateurs et d'indices de référence tenu par l'ESMA. L'indice est disponible sur le site : <https://faircostindex.fr>.

La stratégie d'investissement visera à :

A. construire un portefeuille actions respectant le filtre ISR et constitué de deux poches aux pondérations variables dans le temps et sans effet de levier :

- une première poche regroupant des actions de l'indice FCI EMU 50 ;
- et une seconde poche de type « minimum variance » ayant pour univers d'investissement les 300 plus grandes capitalisations boursières de la zone Euro.

B. couvrir le portefeuille contre le risque de chute brutale des marchés actions de la zone Euro dans la perspective de maîtriser son niveau d'exposition. Cette couverture, qui participe structurellement à la stratégie de gestion, est assurée à travers des prises de positions sur le marché des options listées.

Nous attirons votre attention sur le fait que cette modification est sans impact sur le profil rendement/risque et la structure tarifaire du fonds.

Nous vous invitons à prendre régulièrement contact avec votre conseiller afin de vous permettre d'apprécier l'opportunité de vos placements.

Par ailleurs, notre Service Clients reste à votre écoute :

ECOFI INVESTISSEMENTS - Service Clients

12 boulevard Pesaro - CS10002 - 92024 NANTERRE CEDEX

Tél : 01 44 88 39 24 - Fax : 01 44 88 39 39 - Email : contact@ecofi.fr

Nous restons à votre disposition pour toute précision et nous vous prions d'agréer, Madame, Monsieur, l'expression de nos salutations distinguées.



Claire MARTINETTO
Présidente du Directoire

ECOFI INVESTISSEMENTS - ENTREPRISE A MISSION

Société de gestion de portefeuille agréée par l'Autorité des Marchés sous le numéro GP97004
Société anonyme à directoire et conseil de surveillance au capital de 7 111 836 € - 999 990 369 R.C.S. Nanterre - APE 66.30Z
12 boulevard Pesaro - CS 10002 - 92024 Nanterre Cedex • Téléphone : 33 (0)1 44 88 39 00

www.ecofi.fr