



Communiqué de presse

Paris, 31 janvier 2018

Rothschild Asset Management lance R Perdurance Market Neutral Fund, le nouveau compartiment de sa Sicav InRIS dédiée aux stratégies alternatives au format UCITS

Fruit du partenariat exclusif entre Rothschild Asset Management, la société de gestion Perdurance Asset Management et la plateforme de comptes gérés Innocap, R Perdurance Market Neutral Fund offre une solution de diversification liquide et décorrélée des marchés d'actions.

Gérée par Ivan Briery, co-fondateur et ex-gérant du célèbre fonds Voltaire, cette stratégie « *Equity Market Neutral* » à dominante européenne est fondée sur une approche fondamentale visant l'identification d'opportunités d'investissement via un modèle d'évaluation propriétaire intégrant une analyse minutieuse des éléments comptables des sociétés et une rencontre systématique des équipes dirigeantes. Après une évaluation approfondie du *béta* et des éventuels biais sectoriels, géographiques ou de style de la jambe acheteuse (« *long* ») du portefeuille, le gérant met en place des couvertures (« *short* ») via des indices afin de les neutraliser. R Perdurance Market Neutral Fund offre un objectif de rentabilité/risque attrayant pour une volatilité cible de 8 à 10% et un ratio de Sharpe cible de 0,8.

« Aux côtés de R CFM Diversified Fund, R Parus Fund et R Karya Macro Fund, R Perdurance Market Neutral Fund vient enrichir une gamme resserrée de fonds alternatifs UCITS complémentaires, tant en matière de couple rentabilité/risque, de stratégies sous-jacentes que de liquidité. » souligne Charles Lacroix, Responsable du Business Development de la plateforme.

Créée en juillet 2013 avec pour ambition d'offrir aux investisseurs des solutions différenciantes et innovantes construites à partir de leurs besoins et de l'identification de gérants talentueux, InRIS, la plateforme alternative UCITS de Rothschild Asset Management compte à présent près de 4 milliards d'euros sous gestion.

Fondée en 2014, Perdurance Asset Management est une société de gestion qui a prouvé sa capacité à générer de l'*alpha* tout en étant parfaitement décorrélée des marchés d'actions par un processus de gestion rigoureux utilisant des modèles propriétaires de valorisation. Détenue à 60% par Ivan Briery et à 40% par Perdurance Philanthropy, la société de gestion reverse 40% de ses bénéfices à des œuvres philanthropiques, liées aux droits humains, à l'éducation de la petite enfance défavorisée, à la santé ou bien encore à l'entrepreneuriat social.

R Perdurance Market Neutral Fund est disponible à la commercialisation en France, en Allemagne, en Italie, en Grande-Bretagne, en Espagne, en Belgique, au Luxembourg, en Suisse ainsi qu'aux Pays-Bas.

- FIN -

Pour plus d'information:

Rothschild Asset Management

Muriel Helvadjian

Tel: +33 1 40 74 49 24

Muriel.helvadjian@rmm-co.com

A propos de Rothschild Martin Maurel Asset Management

Rothschild Martin Maurel Asset Management propose des solutions d'investissement innovantes, fruit d'une vision indépendante et de long-terme, conçues pour répondre aux besoins de chacun de ses clients. Fort de sa présence internationale, Rothschild Martin Maurel Asset Management offre des services personnalisés de gestion et de conseil en investissement à une large clientèle d'investisseurs institutionnels, d'intermédiaires financiers et de distributeurs. Nourrie par une connaissance profonde de



ses clients, Rothschild Martin Maurel Asset Management articule son développement autour de trois expertises complémentaires en gestion active et de conviction, en architecture ouverte et en solutions d'investissement quantitatives fondées sur des modèles de risques. Rothschild Martin Maurel Asset Management combine expérience et technologies les plus avancées pour élaborer des solutions d'investissement véritablement sur-mesure pour chacun de ses clients. Cette approche, alliant innovation et expérience, permet à Rothschild Martin Maurel Asset Management d'offrir à ses clients une vision différente, source de création de valeur sur le long-terme.

Plus d'information sur : www.rothschildgestion.com