

iM Global Partner lance un nouveau fonds UCITS : l'iMGP DBi Managed Futures

Les investisseurs européens ont maintenant accès à la stratégie de *Managed Futures*, qui a collecté plus de 1 Mds USD en 2022 aux Etats-Unis.

Luxembourg - 16 février 2023. Suite à l'accord de la CSSF fin décembre, iM Global Partner a annoncé le lancement d'un nouveau fonds UCITS, **iMGP DBi Managed Futures** géré par son partenaire spécialiste de la gestion alternative liquide, Dynamic Beta investments (« DBI »). Grâce au vif intérêt de certains investisseurs européens, le fonds voit son encours atteindre déjà 60 millions d'euros pour son lancement.

Jamie Hammond, directeur général adjoint de iM Global Partner, responsable de la distribution internationale, a commenté : « Les *Managed Futures* ont été l'une des classes d'actifs les plus performantes en 2022, et notre stratégie d'ETF Managed Futures distribuée aux Etats-Unis (DBMF) a bénéficié d'un soutien considérable de la part des investisseurs qui recherchent une source de diversification faiblement corrélée aux actions. Par exemple, l'indice SG CTA a eu une corrélation négative de -0,02 avec les actions mondiales (indice MSCI World) au cours des 5 dernières années. C'est pourquoi nous avons reçu de nombreuses demandes de la part d'investisseurs basés en Europe pour rendre cette stratégie accessible sous forme d'OPCVM. »

Dynamic Beta Investments (DBI) est le gérant délégué du **iMGP DBi Managed Futures**, un nouveau compartiment de la SICAV UCITS domiciliée au Luxembourg, iMGP.

Andrew Beer, Dynamic Beta investments, Co-Portfolio Manager du fonds, a déclaré : « Les '*Managed futures*' offrent des avantages de diversification plus importants dans une allocation traditionnellement diversifiée à l'aide d'actions et d'obligations que le capital-investissement, la dette privée, l'immobilier, les matières premières et bien d'autres classes d'actifs alternatives couramment utilisés. Pourtant, peu de gestionnaires de patrimoine et d'investisseurs institutionnels en Europe ont des allocations significatives sur les *Managed Futures*. Avec ce fonds, nous voulons changer cela ».

iM Global Partner a lancé cette stratégie il y a 3 ans pour le marché américain qui est devenu le plus grand ETF *Managed Futures* du secteur en termes d'actifs sous gestion (source : etfdb.com au 30 janvier 2023).

Le DBMF basé aux États-Unis a connu une croissance extraordinaire en 2022, augmentant ses actifs sous gestion de 60 millions de dollars en 2021 à environ 1 milliard de dollars à la fin de 2022 et affichant un rendement sur 1 an de 23,1 % contre -18,1 % pour l'indice MSCI World (source Morningstar, rendements totaux basés sur la valeur liquidative).

Les performances passées ne préjugent pas des performances futures. Les rendements peuvent augmenter ou diminuer en raison des fluctuations des devises. Tous les chiffres sont au 31 décembre 2022. Source iM Global Partner sauf indication contraire)

Le fonds iMGP DBi Managed Futures

Ce nouveau fonds cherche à répliquer les rendements avant frais et coûts de transaction de des principaux fonds *Managed Futures* existants dans une enveloppe UCITS. En ciblant la performance d'un portefeuille de différents fonds, il cherche à minimiser le risque lié à la sélection d'un seul gestionnaire.

Le fonds cherche à répliquer les facteurs de risque des *Managed Futures* ciblés avec un portefeuille ajusté dynamiquement via contrats à terme liquides.

Le fonds iMGP DBi Managed Futures n'investit pas directement dans des fonds. DBi utilise des modèles quantitatifs pour estimer les pondérations factorielles d'un groupe de *Managed Futures* diversifié et investit à l'aide de contrats 'Futures' (contrat à terme sur indice) pour obtenir des expositions similaires. Le portefeuille est réajusté chaque semaine.

À propos d'iM Global Partner

iM Global Partner est un réseau mondial de gestion d'actifs. Nous sélectionnons et construisons des partenariats à long terme avec des sociétés de gestion d'actifs talentueuses et indépendantes par le biais d'une participation directe au capital. Nous sommes présents sur 11 sites en Europe et aux États-Unis et offrons à nos clients l'accès aux meilleures stratégies d'investissement de nos partenaires. Nous avons plus de 35 milliards USD d'actifs sous gestion à la fin décembre 2022.

Partenaires avec iM Global Partner

Polen Capital - Actions de croissance américaines et mondiales, partenaire depuis 2015.

Dolan McEniry - Crédit américain, partenaire depuis 2016

Sirios - Actions US long/short, Crédit US, partenaire depuis 2018

Dynamic Beta investments - Alternatives liquides, partenaire depuis 2018

Scharf Investments - Actions américaines de type "value", partenaire depuis 2019

Zadig Asset Management - Actions européennes, partenaire depuis 2020

Richard Bernstein Advisors - Allocation d'actifs globale, partenaire depuis juillet 2021

Asset Preservation Advisors - Obligations municipales américaines, partenaire depuis septembre 2021

Berkshire Asset Management - Actions américaines axées sur les dividendes, partenaire depuis décembre 2022

imgp.com

A propos de la gamme de fonds iMGP UCITS

La gamme de fonds iMGP vise à mettre à la disposition des conseillers financiers, des consultants, des clients institutionnels et des investisseurs individuels, des stratégies d'investissement de haute qualité, élaborées par des gestionnaires de portefeuille talentueux du monde entier. La mission d'iM Global Partner est de trouver des stratégies distinctes dans des classes d'actifs qui, selon elle, offrent la meilleure opportunité d'ajouter de la valeur grâce à une gestion active. Dans la plupart des cas, les stratégies qu'iM Global Partner apporte sur le marché ne sont disponibles dans aucun autre fonds géré. La gamme iMGP est une SICAV UCITS à compartiments multiples et est réglementée par la CSSF. La SICAV est gérée par iM Global Partner Asset Management, avec l'objectif de nommer les meilleurs gestionnaires de fonds pour fournir des stratégies de haute qualité via 18 compartiments iMGP.

À propos de Dynamic Beta investments

DBi a été fondée à New York en 2012 par Andrew Beer et Mathias Mamou-Mani et possède l'un des plus longs track records dans l'espace de réplique de hedge funds, avec le lancement de son premier produit en 2007. Aujourd'hui, DBi gère trois stratégies principales qui cherchent à répliquer la performance avant frais de portefeuilles de hedge funds dans les catégories Managed Futures, Equity Long/Short et Multi-Strategy (Equity Long/Short, Relative Value et Event-Driven). iM Global Partner a acquis une participation non-contrôlante dans DBi en septembre 2018. Les investissements Dynamic Beta avaient plus de 2,1 milliards de dollars d'actifs sous gestion à la fin décembre 2022.

www.dynamicbeta.com

Contact presse

Justine Trueman

media@imgp.com

Tel : +33 1 88 40 75 16

Avis de non-responsabilité

Le présent document est une communication commerciale. Il ne s'agit pas d'un document contractuel contraignant, ni d'un document d'information requis par la loi. Les informations contenues dans ce document ne constituent pas une offre ou une recommandation d'achat ou de vente de parts du fonds et ne sont pas suffisantes pour prendre une décision d'investissement. Veuillez vous référer au prospectus et au KID du fonds avant de prendre une décision d'investissement définitive. Ces documents, qui contiennent des informations complètes sur les risques associés à l'investissement, sont disponibles en anglais sur www.imgp.com.

L'investissement concerne l'acquisition de parts ou d'actions d'un fonds et non d'un actif sous-jacent donné.