

Russell Investments U.S. Quant Fund



Nick Haupt, CFA
Gérant du fonds

L'équipe Actions internationales de Russell Investments compte plus de 23 professionnels chevronnés, dont des gérants de portefeuille, des chercheurs, des analystes de portefeuille et des stratéges, répartis dans les bureaux de Russell Investments partout dans le monde. L'équipe gère une vaste gamme de mandats aux Etats-Unis, dans les autres pays développés, sur les marchés émergents, les marchés frontières et les marchés actions internationaux

Objectif d'investissement

Le fonds vise à réaliser une croissance à long terme en investissant au moins 70 % de ses actifs dans des actions de sociétés américaines, en utilisant des formules mathématiques et des modèles informatiques (« méthodes quantitatives »). Le fonds est géré de manière active par référence à l'indice Russell 1000 Index Net Returns of Withholding Tax 30 % (l'« indice ») qu'il cherche à dépasser de 1,15 % à moyen et long terme. Les gérants de Russell Investments ont toute latitude pour sélectionner les investissements du fonds.

Sources de performance

Le fonds continue d'être géré de manière dynamique, conformément au cycle, à la valorisation et au sentiment d'Investissements Russell, ainsi que pour tirer parti d'opportunités tactiques au sein du cycle de rentabilité de chaque gestionnaire. Le fonds maintient une exposition aux facteurs de valeur et de croissance, ainsi qu'un penchant pour le momentum, la qualité, les faibles capitalisations et la faible volatilité. Conformément aux convictions stratégiques d'Investissements Russell en matière d'actions, la sélection des actions par les gestionnaires d'actifs sous-jacents, sur la base de leur évaluation à long terme de chaque société, continue d'être le principal moteur du risque et de la rentabilité attendus du Fonds.

Tableaux de performances %

Performance en fin de période Performances en USD	1 mois	3 mois	6 mois	Year to date	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Depuis création
Performances nettes Class R1 Roll-Up	-4,6	4,2	21,6	6,2	23,2	7,2	11,7	-	11,8
Russell 1000 Index (USD) Net Returns of Withholding Tax 30%	-4,3	4,0	20,9	5,5	22,3	6,5	12,3	-	13,1

Les performances supérieures à 1 an sont annualisées

Performance glissante sur 12 mois (%)

Performances en USD	31/03/23 31/03/24	31/03/22 31/03/23	31/03/21 31/03/22	31/03/20 31/03/21	31/03/19 31/03/20
Performances nettes Class R1 Roll-Up	30,13	-8,74	14,33	56,51	-10,43
Russell 1000 Index (USD) Net Returns of Withholding Tax 30%	29,28	-8,85	12,82	59,82	-8,55

Performances en USD	31/03/18 31/03/19	31/03/17 31/03/18	31/03/16 31/03/17	31/03/15 31/03/16	31/03/14 31/03/15
Performances nettes Class R1 Roll-Up	3,35	12,57	15,90	-	-
Russell 1000 Index (USD) Net Returns of Withholding Tax 30%	8,68	13,34	16,72	-	-

Les performances passées ne préjugent pas des performances futures.

L'indice de référence actuel est le Russell 1000 Index (USD) Net Returns of Withholding Tax 30% converti en Euro.

Fund facts
Part; Devise
R1 Roll-Up; USD
Liquidité; Cut off
Daily; 2:00 pm GMT
Domiciliation; Type
Irlande; UCITS
Actifs nets du Fonds
USD 86,91m
Date de lancement du fonds
03 décembre 2001
Date de lancement de la part
24 mars 2016
Frais de gestion annuels
1,20%
ISIN; Bloomberg
IE00BD081238; RUSQR1R ID
Valeur liquidative
USD 9,96m

Russell Investments U.S. Quant Fund

Analyse du risque

	Fonds	Indice
Nombre de lignes	382	1006
Price/Earnings	21,1	22,0
Dividend Yield	1,3	1,3
Price to Book	3,7	3,7
EPS Growth (1 Year)	31,1	21,0

3 ans	Fonds	Indice
Volatilité	17,0	17,0
Tracking error	1,979	1,979
Ratio de Sharpe	0,4	0,4
Ratio d'Information	1,1	1,1
Performance sur 3 ans (nette)	7,2%	6,5%
Superperformance sur 3 ans (nette)	0,7%	-

Dix principales positions

Issuer	Fonds	Indice
Microsoft Corp	5,9%	6,3%
Apple Inc	5,7%	5,4%
NVIDIA Corp	4,1%	4,5%
Alphabet Inc	3,4%	3,9%
Amazon.com Inc	2,3%	3,4%
Meta Platforms Inc	2,2%	2,1%
Mastercard Inc	1,7%	0,8%
Eli Lilly & Co	1,4%	1,4%
Booking Holdings Inc	0,9%	0,3%
Merck & Co Inc	0,9%	0,7%

Données ESG

	Fonds	Indice
Score ESG	21,0	21,5
Carbon Footprint	105,1	97,5

Source : La notation de risque ESG au niveau du portefeuille est la moyenne pondérée de la notation de risque de Sustainalytics pour les titres du portefeuille. Les détails de l'évaluation des risques de Sustainalytics sont disponibles à l'adresse suivante : <https://www.sustainalytics.com/esg-data>. L'empreinte carbone est l'intensité carbone moyenne pondérée de l'intensité des émissions de carbone de portée 1 et 2 des entreprises du portefeuille. Elle est mesurée en tonnes d'équivalent CO2 divisé par le chiffre d'affaires (en millions de dollars américains).

Exposition sectorielle

	Fonds	Indice
Technologie de l'information	28,0%	27,9%
Finance	13,8%	13,7%
Santé	12,8%	12,2%
Industrie	10,9%	9,7%
Consommation discrétionnaire	9,8%	10,4%
Services de communication	8,9%	8,9%
Consommation de base	5,4%	5,9%
Énergie	3,3%	4,1%
Matériaux	2,9%	2,5%
Services aux collectivités	2,2%	2,3%
Immobilier	1,9%	2,4%
Autres	0,0%	0,0%
Infrastructures	0,0%	0,0%

Russell Investments U.S. Quant Fund

Composition du portefeuille

Gérant	Style De Gestion	Cible	Actuelle
Jacobs Levy Equity Management, Inc.	Market-Oriented	34,0%	31,9%
Numeric Investors LLC	Market-Oriented	34,0%	32,3%
Russell Investments	Positioning Strategies	32,0%	35,8%

Russell Investments peut négocier une partie des actifs du fonds en se basant sur un portefeuille modèle fourni par le conseiller en investissements. En utilisant cette approche de portefeuille émulé, le fonds tire parti des capacités d'exécution de Russell Investments dans le but de gérer les avoirs plus efficacement.

Important Information

La présente communication ne peut être considérée comme une offre ou une sollicitation dans les juridictions où celles-ci sont contraires à la loi.

Sauf mention contraire, Russell Investments est la source de toutes les données. Toutes les informations contenues dans ce document sont valables à la date de publication et exactes en l'état actuel de nos connaissances. Les opinions exprimées par Russell Investments ne sont pas un état de fait, elles peuvent évoluer et ne constituent nullement un conseil d'investissement.

La valeur des investissements et les revenus qui en découlent peuvent varier à la hausse comme à la baisse et ne sont en aucun cas garantis. Il est possible que vous ne récupériez pas le montant investi au départ.

Les performances passées ne permettent pas de prévoir les performances futures.

Les actifs nets du Fonds sont susceptibles d'avoir une volatilité élevée.

Les investisseurs qui envisagent d'investir dans les marchés émergents doivent savoir que ceux-ci peuvent présenter un degré de risque élevé.

Les rendements indexés sur des devises mentionnés peuvent augmenter ou diminuer en raison des fluctuations des taux de change. Les traitements fiscaux varient en fonction de la situation particulière de chacun et peuvent changer à tout moment.

Ce document constitue une communication marketing. Veuillez vous référer au prospectus de l'OPCVM et au KIID/KID avant de prendre toute décision finale d'investissement.

Au Royaume-Uni, ce document marketing est publié par Russell Investments Ireland Limited. Immatriculée en Angleterre et au Pays de Galles sous le n° 02086230 et dont le siège social se situe au : Rex House, 10 Regent Street, London SW1Y 4PE. Téléphone +44 (0)20 7024 6000. Agréée et réglementée par la Financial Conduct Authority, 12 Endeavour Square, London, E20 1JN, Royaume-Uni. Dans l'Union européenne, ce document marketing est publié par Russell Investments Ireland Limited. Immatriculée en Irlande sous le n° 213659 et dont le siège social se situe au : 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2, Irlande. Autorisée et réglementée par la Banque centrale d'Irlande. Au Moyen Orient, ce document marketing a été publié par Russell Investments Limited, une société du Dubai International Financial Centre, qui est réglementée par la Dubai Financial Services Authority au : Office 4, Level 1, Gate Village Building 3, DIFC, PO Box 506591, Dubai UAE. Téléphone +971 4 578 7097. Ce document doit s'adresser uniquement aux clients professionnels tel que défini par la DFSA.

Numéro KvK 67296386