

WG Momentum Factor Fund

Un fonds actions appliquant un modèle de gestion quantitatif permettant de sélectionner de manière mécanique les valeurs ayant surperformé historiquement le marché pour optimiser la performance à long terme

Principales caractéristiques

- ISIN : MA0000042335
- Indice de référence : 100% MASI*
- Affectation des résultats : Capitalisant
- Profil de rendement/risque :

1	2	3	4	5	6	7
---	---	---	---	---	---	---

* Indice représentatif du marché actions



OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

WG Momentum Factor Fund a pour objectif de réaliser une performance supérieure ou égale à celle du marché actions marocain sur un horizon de 5 ans.

Pour ce faire, le fonds investit dans les actions marocaines ayant surperformé le benchmark historiquement ; une caractéristique appelée communément «**persistance de la surperformance**» ou «**Momentum**».

Le fonds adopte une **approche de gestion quantitative basée sur un modèle mathématique**. Ce modèle est dit «factoriel» car les décisions de gestion initiées sont principalement basées sur l'évolution du facteur «Momentum».

A qui le fonds s'adresse-il?

Aux investisseurs souhaitant faire fructifier leur capital à long terme à travers un style de gestion actions quantitatif s'appuyant sur un modèle mathématique.

Avantages

Gestion autonome sous la supervision d'experts
Objectifs paramétrés et précis, excluant les émotions
Solution de placement différenciante



PHILOSOPHIE DE GESTION

Les décisions de gestion sont principalement basées sur la persistance de surperformance. Ce modèle s'appuie sur l'hypothèse selon laquelle **les actions qui ont surperformé leur indice de référence par le passé continueront probablement à surperformer dans le futur**, tandis que celles qui ont sous-performé historiquement continueront sans doute à rester peu attractives à l'avenir.

Critères de sélection des actions par le modèle :

Capitalisation boursière : l'univers d'investissement se limite aux 40 plus grandes capitalisations de la Bourse de Casablanca

Liquidité : le modèle de gestion sélectionne au sein de l'univers d'investissement les 20 actions les plus liquides

Momentum : la pondération des actions au sein du fonds est ajustée en fonction des performances historiques. Le modèle favorise les actions dont la surperformance de l'indice de référence s'est révélée persistante sur une durée de 6-12 mois.

L'univers d'investissement est mis à jour trimestriellement.



EQUIPE DE GESTION

Les OPCVM Actions et Diversifiés sont gérés par une équipe dédiée d'experts des marchés financiers, travaillant de manière collégiale.

Ils s'appuient également sur des expertises internes, notamment des gérants de portefeuilles Taux, une équipe de Recherche & Analyse, un département de Gestion Internationale, ainsi qu'un Risk Manager assurant une surveillance permanente des risques en portefeuilles.

Des comités périodiques permettent d'assurer des contrôles et suivis complémentaires des processus mis en place.



MODALITÉS DE SOUSCRIPTION

- Valorisation du fonds : Hebdo, tous les Vendredi
- Souscription/Rachat: Les ordres sont reçus du Lundi au Jeudi jusqu'à 16h, et sont exécutés sur la base de la prochaine Valeur Liquidative.
- Frais d'entrée : Max 2% du montant souscrit dont 0,4% acquis par le fonds.
- Frais de sortie : Max 1,5% du montant racheté dont 0,4% acquis par le fonds

Avertissement

Le profil rendement/risque présente le niveau de risque auquel expose le fonds, relativement au rendement espéré. La catégorie la plus faible ne signifie pas «sans risque». Le profil n'est pas garanti et pourra évoluer dans le temps. De même, la valeur du fonds est susceptible de fluctuer significativement suivant les conditions de marché, et aucun capital ne peut être garanti. Pour plus de détails sur la politique d'investissement, veuillez vous référer à la Note d'Information ou la Fiche Signalétique du fonds. Ce document est fourni à titre d'information et ne constitue pas une recommandation ou sollicitation à l'achat ni à la vente. Wafa Gestion n'accepte aucune responsabilité, directe ou indirecte résultant de l'utilisation d'informations contenue dans ce document.