



## AVANTIETOEESITE

Tämä asiakirja sisältää sijoittajalle annettavat avaintiedot rahastosta. Se ei ole markkinointiaineistoa. Avaintiedot on annettava lakisääteisesti, jotta sijoittaja ymmärtäisi rahaston luonteen ja siihen liittyvät sijoitusriskit. Asiakirjaan tutustumista suositellaan, jotta sijoittaja voisi tehdä sijoituspäätöksensä tietoon perustuen.

## ERIKOISSIJOITUSRAHASTO EVLI FACTOR PREMIA

Kasvuosuus, osuussarja B (ISIN: FI4000282777)

Tätä rahastoa hallinnoi Evli-Rahastoyhtiö Oy, joka kuuluu Evli-konserniin.

### TAVOITTEET JA SIJOITUSPOLITIikka

Evli Factor Premia (jäljempänä "Rahasto") on vaihtoehtorahastojen hoitajista annetun lain (162/2014) mukainen vaihtoehtorahasto.

Rahaston varat sijoitetaan markkinaneutraalisti systemaattisten faktoristrategioiden mukaisesti maailmanlaajuisesti mm. osakkeisiin, osakeindekseihin, raaka-aineisiin, valuuttoihin ja korkoinstrumentteihin hyödyntämällä mm. vakioituja ja vakioimattomia johdannaissopimuksia sekä tuottojenvaihtosopimuksia. Rahaston sijoitukset hajautetaan laajasti useiden eri omaisuusluokkien ja akateemisesti todettujen faktoreiden, kuten arvo, trendi, laatu, carry ja momentum, välille. Saavuttaakseen halutun altistuksen valituille faktoreille rahasto voi sekä ostaa että myydä arvopapereita lyhyeksi. Rahaston tuottojen korrelaatio perinteisiin omaisuusluokkiin pyritään pitämään matalana hyödyntämällä hedge-rahastolle tyypillisiä markkinaneutraaleita sijoitusstrategioita.

Rahaston sijoitustoiminnan tavoitteena on mahdollisimman korkea tuotto pitkän aikavälin tavoitteeksi asetetulla 8 % volatiteettitasolla. Rahasto käyttää sijoitustoiminnassaan johdannaisia ja vivutuksen taso voi olla enintään 20. Rahaston vivutustaso vaihtelee riippuen erityisesti korkoinstrumenttien määrästä. Korkojohdannaisista laskettava sijoitusaste on yleensä suuri kohde-etuuden laskentatavasta johtuen. Rahaston odotettu riskitaso pidetään kuitenkin vakiona yli ajan.

Rahasto voi sijoittaa varojaan vakioituihin ja vakioimattomiin johdannaissopimuksiin sekä suojaustarkoituksessa että osana rahaston tavoitteiden mukaista sijoitustoimintaa.

Rahastolla ei ole virallista vertailuindeksiä eikä toimiala- tai maakohtaisia rajoitteita maantieteellisen sijoitusalueensa sisällä.

Rahaston perusvaluutta on euro.

Rahaston sijoituskohteiden tuotot sijoitetaan uudestaan.

Rahasto-osuuksia voi merkitä ja lunastaa jokaisena suomalaisena pankkipäivänä, pois lukien sellaiset pankkipäivät, jolloin rahaston tai sen sijoituskohteiden arvoa ei voida määrittää ulkomaisista pyhä- tai pankkivapaapäivistä johtuen. Kaupankäynti rahasto-osuuksilla ei myöskään ole mahdollista, mikäli rahastoyhtiö on väliaikaisesti keskeyttänyt rahasto-osuuksien arvonlaskennan poikkeuksellisen epävakaan tai ennalta arvaamattoman markkinatilanteen, poikkeuksellisten olosuhteiden tai muun painavan syyn johdosta. Tiedot päivistä, jolloin rahasto-osuuksien kaupankäynti ei ole mahdollista, on saatavissa Rahastoyhtiöstä sekä Rahastoyhtiön Internet-sivuilta.

Suositus: Tämä rahasto ei ehkä sovellu sijoittajille, jotka aikovat luopua osuuksistaan rahastossa 4 vuoden kuluessa.

Lisätietoja rahastosijoittamisesta on saatavissa rahastoesteestä sekä osoitteesta [www.evli.com/rahastot](http://www.evli.com/rahastot).

### RISKI-TUOTTOPROFIILI



Riski-tuotto-profiili kuvaa rahasto-osuuden arvonkehityksen vaihtelua viimeisen 5 vuoden ajalta. Rahaston riski-tuotto-profiili ja riskiluokka voivat muuttua. Riski-tuottokuvaajan alinkaan luokka (1) ei ole täysin riskitön. Historiallisten tietojen perusteella ei voida ennustaa rahaston riski-tuotto-profiilin ja riskiluokan tulevaa kehitystä.

Rahastojen riskitaso luokitellaan asteikolla 1-7, jossa 1 tarkoittaa pientä riskiä ja 7 suurta riskiä. Rahaston nykyinen riskiluokka on 4. Tämä tarkoittaa, että rahaston arvonkehitykseen liittyy keskimääräinen riski.

Rahaston kokonaisriskiin vaikuttavat myös seuraavat riskitekijät, joita riskiprofiili ei välttämättä huomioi täysimääräisesti:

- Luottoriski: Epävarmuus lainan liikkeeseenlaskijan takaisinmaksukyvyistä.
- Erityisten tapahtumien riski: Ennalta arvaamattomat tapahtumat kuten äkillinen rahan arvon aleneminen tai poliittiset tapahtumat.
- Johdannaisriski: Johdannaisten käyttäminen lisätuottojen saavuttamiseen voi lisätä rahaston riskiä ja tuotto-odotusta. Johdannaisten käyttäminen suojaustarkoitukseen tai riskien hallintaan voi vähentää riskiä ja tuotto-odotusta. Johdannaisten käyttö voi lisätä vastapuoli- ja operatiivisia riskejä.
- Vastapuoliriski: Vastapuoliriskillä tarkoitetaan sitä, että Rahaston vastapuoli laiminlyö veloitteensa ennen transaktioon liittyvän kassavirran lopullista selvittämistä.
- Markkinariski: Rahaston sijoitusten markkina-arvot voivat vaihdella markkinahintojen yleisen arvonkehityksen seurauksena.
- Likviditeettiriski: Rahaston sijoituksia ei välttämättä voida realisoida suunnitellussa ajassa tai toivottuun hintaan. Rahasto pyrkii sijoittamaan enimmäkseen korkean likviditeetin sijoitusinstrumentteihin.

## RAHASTON KULUT

Sijoittajan maksamia kuluja käytetään rahaston toimintakustannusten, kuten markkinointi- ja jakelukustannusten, maksamiseen. Nämä kulut vähentävät sijoituksen mahdollista tuottoa.

### Rahasto-osuuksien merkitsemiseen ja lunastamiseen liittyvät palkkiot

Merkintäpalkkio	0%
Lunastuspalkkio	0%

Merkintäpalkkio ja lunastuspalkkio on ilmoitettu enimmäismäärinä, jotka sijoituksesta voidaan veloittaa kuluina merkinnän ja lunastuksen yhteydessä. Tarkempia tietoja on saatavilla voimassa olevasta hinnastosta, rahastoyhtiöstä tai rahastoyhtiön asiamieheltä.

### Rahastosta vuoden aikana veloittavat maksut

Juoksevat kulut	1.03%
-----------------	-------

Juoksevat kulut perustuvat vuonna 2020 perittyihin kuluihin. Niiden määrä voi vaihdella vuodesta toiseen. Ne eivät sisällä:

### Rahastosta erityisissä tilanteissa veloittavat maksut

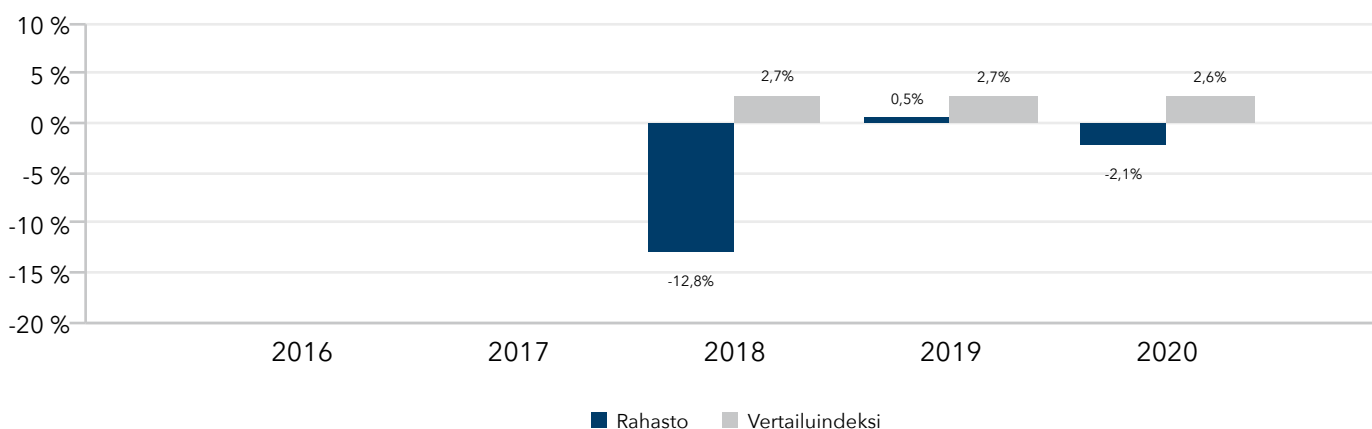
Tuottosidonnainen palkkio	0.00%
---------------------------	-------

Tuottosidonnainen palkkio on 10 % siitä osasta tuottoa, joka ylittää vertailuarvon tuoton. Vertailuarvo on ICE BofAML Euro Currency 3-month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index + 3 % vuodessa. Tuottoero lasketaan päivähavainnoista ja siihen sovelletaan High Watermark -periaatetta vähintään 24 kuukauden pituiselta ajalta. Edellisen vuoden tuottosidonnainen palkkio prosenttiosuutena. Mikäli viitearvon hallinnoija lopettaisi indeksin hallinnoinnin tai muuttaisi sitä olennaisesti, pyrkii rahastoyhtiö korvaamaan vertailuarvon toisella vastaavalla indeksillä jatkuvuussuunnitelmansa mukaisesti. Viitearvon hallinnoija on merkitty ESMA:n ylläpitämään rekisteriin Vertailuarvoasetuksen edellyttämällä tavalla.

- tuottosidonnaista palkkiota
- rahaston maksamia kaupankäyntikuluja.

Lisätietoja kuluista on esitetty virallisessa rahastoesitteessä sekä rahastojen hinnastossa, jotka ovat saatavilla osoitteesta [www.evli.com/rahastot](http://www.evli.com/rahastot).

## AIEMPI TUOTTO TAI ARVONKEHITYS



Rahasto on aloittanut toimintansa 1.11.2017. Tuottohistoriassa huomioidaan rahasto-osuuden hallinnointipalkkio, mutta ei sijoittajan maksamia merkintä- tai lunastuspalkkiota eikä mahdollisia veroja. Rahasto-osuuden arvonkehityksen laskentavaluutta on euro. Historiallinen tuotto ei ole tae tulevasta tuotosta.

## KÄYTÄNNÖN TIEDOT

- Rahaston säilytysyhteisönä toimii Skandinaviska Enskilda Banken AB (publ) Helsingin sivukonttori. Rahaston omaisuudenhoidosta vastaa Evli-Rahastoyhtiö Oy.
- Rahaston tilintarkastajana toimii PricewaterhouseCoopers Oy KHT-yhteisö.
- Rahaston säännöt, avaintietoesite ja muut rahastojulkaisut ovat saatavilla osoitteesta [www.evli.com/rahastot](http://www.evli.com/rahastot) ja Sijoittajapalvelusta puh. (09) 4766 9701, ma-pe 9.30 - 16.30.
- Rahasto-osuuksien viimeisimmät noteeraukset ovat saatavilla osoitteesta [www.evli.com/rahastot](http://www.evli.com/rahastot) tai My Evli -verkkopalvelusta.
- Rahaston kotivaltion verolainsäädäntö voi vaikuttaa sijoittajan henkilökohtaiseen verotukseen.
- Evli-Rahastoyhtiö Oy voidaan saattaa vastuuseen vain sillä perusteella, että tämä asiakirja sisältää harhaanjohtavia tai epätarkkoja tietoja tai tietoja, jotka ovat ristiriidassa rahastoesitteen kanssa.
- Rahaston osuudet jaetaan tuotonjaon perusteella tuotto- ja kasvuosuuksiin. Kasvuosuuksille ei jaeta tuottoa, vaan kaikki tuotot (kuten osingot ja korkotulo) sijoitetaan uudelleen kasvuosuuksien arvon kasvattamiseksi. Tuotto-osuuksille jaetaan vuosittain tuottoa, joka vähentää tuotto-osuuksille laskettavaa osuutta rahaston pääomasta. Tuotonjaossa pyritään tasaisuuteen, mistä johtuen tuotonjako ei ole sidottu rahaston tilikauteen eikä viimeksi päätyneen tai aikaisempien tilikausien tulokseen. Tuotonjaon seurauksena tuotto-osuuden arvo saattaa laskea alle sen merkintähinnan.
- Rahasto voi laskea liikkeelle myös muussa kuin sen perusvaluutassa noteerattuja osuuksia.
- Tietoja rahastoyhtiön palkitsemiskäytännöstä on saatavilla osoitteesta [www.evli.com](http://www.evli.com).

Rahaston säännöt ovat voimassa 1.10.2020 alkaen. Evli-Rahastoyhtiö Oy:lle on myönnetty lupa toimia vaihtoehtorahastojen hoitajana Suomessa. Rahastoa ja hallinnointiyhtiötä valvoo Finanssivalvonta. Tämä avaintietoesite on voimassa 19.2.2021 alkaen.