À propos d'Evovest

Evovest a été fondé sur la prémisse de réinventer la gestion de portefeuille par la science. Tirer parti des avancées en apprentissage machine tout en établissant de solides relations avec nos clients, voilà comment nous entendons réaliser notre vision au quotidien. Nous sommes une société de gestion de portefeuille inscrite auprès de l'Autorité des marchés financiers (AMF) et de la commission des Valeurs mobilières de l'Ontario (CVMO).

Revue Trimestrielle

Face à la pandémie de la COVID-19 , les marchés ont connu une volatilité exceptionnelle au cours du dernier trimestre. Ce fut pour nous l'occasion de mettre à l'épreuve nos processus opérationnels et d'investissement. Notre confiance en la capacité de nos stratégies à résister à des périodes de fortes turbulences en ressort grandie. En effet, nos stratégies ont surperformé leurs indices respectifs ou les ont sinon sous-performé par une faible marge. En janvier, nous avons lancé officiellement une initiative pour trouver du capital de lancement pour le fonds Evovest Actions Mondiales Marché Neutre en participant à l'événement Context Summit 2020 à Miami. Nous sommes heureux de la réaction que nous avons reçue et poursuivons la recherche d'investisseurs pour ce produit. Nous vous invitons à communiquer avec nous si vous désirez plus d'information sur celui-ci.

En février, Jérémie a participé à l'événement HEC Forecast 2020 en tant que panéliste pour discuter des approches algorithmiques utilisées chez une FinTech. Il a aussi accueilli la délégation de Strasbourg à la Station Fintech pour leur introduire notre application de l'apprentissage machine en investissement.

Actions Mondiales

Dans le contexte de rendement largement négatif sur les marchés, notre stratégie Evovest Actions Mondiales s'est comparée favorablement à son indice dans le dernier trimestre en donnant un rendement de – 16,8% en valeur absolue et +2,9% en relatif. Nous avons aussi marqué le premier anniversaire de la stratégie en date du 31 janvier 2020. Les résultats depuis le début nous donnent confiance dans le processus avec une surperformance de +4,3%.

Lancement 31 Jan 2019	Evovest	Indice
Rendements T1 2020	-16,8%	-19,7%
Rendements Annualisés	-5,0%	-9,3%
Volatilité Annualisée	15,8%	17,7%
Rendement/Risque	-0,3	-0,5
Erreur de suivi	5,1%	N/A
Perte maximale cumulée	-28,7%	-30,6%
Beta	0,86	1,00

Actions Nord-Américaines

Notre stratégie Evovest Actions Nord-Américaines a souffert de manière similaire au marché avec un rendement négatif absolu de -21,1% au premier trimestre de 2020. Cela représente une sous-performance de 0,4% par rapport à l'indice. Depuis le lancement le 1er novembre 2018, la stratégie à livre un rendement annualisé de +3,1%.

Lancement 1er Nov 2018	Evovest	Indice
Rendements T1 2020	-21,1%	-20,7%
Rendements Annualisés	-1,7%	-4,8%
Volatilité Annualisée	22,9%	25,3%
Rendement/Risque	-0,1	-0,2
Erreur de suivi	9,5%	N/A
Perte maximale cumulée	-36,8%	-33,2%
Beta	0,84	1,00

Actions Nord-Américaines Marché Neutre

Notre stratégie Evovest Actions Nord-Américaines Marché Neutre est en baisse de -1,2% au dernier trimestre. Cela est en deçà de nos attentes, mais tout de même supérieur aux stratégies similaires compilées par l'indice Eurekahedge Equity Market Neutral Hedge Fund, qui est à -3,9%. La performance de la stratégie depuis son lancement le 1er novembre 2018 est de +2,7% contre -2,3% sur une base annualisée pour les stratégies similaires.

Lancement 1er Nov 2018	Evovest
Rendements T1 2020	-1,2%
Rendements Annualisés	2,7%
Volatilité Annualisée	7,5%
Rendement/Risque	0,4
Erreur de suivi	NA
Perte maximale cumulée	-8,7%
Beta	0,1

Pour plus d'informations, n'hésitez pas à nous contacter à info@evovest.com

Avertissement:

Les rendements présentés inclus les frais de transactions, mais exclus les frais de gestions et d'opérations. Les rendements passés ne sont pas indicatifs des résultats futures.