EVOVEST

Infolettre T2 2020

À propos d'Evovest

Evovest automatise la prise de décisions d'investissements avec une approche scientifique. L'intelligence artificielle nous permet d'identifier les meilleurs investissements potentiels en analysant l'information financière et macroéconomique. Notre approche se démarque par l'intégration des meilleures pratiques en gestion de portefeuille et en apprentissage machine. Notre engagement consiste à générer des rendements supérieurs par le biais d'une approche innovante à un coût compétitif. 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 T2 2020

Le dernier trimestre a été à marqué par un rebond historique des marchés dans un contexte où la volatilité est demeurée très élevée. La première moitié de l'année s'est ainsi posée comme un test important pour la robustesse de nos stratégies, lesquelles se sont toutes démarquées par une création de valeur versus leurs comparables.

Nous sommes très fiers d'annoncer officiellement l'ajout de Michel Tremblay en tant que président du conseil d'administration chez Evovest. Michel apporte une grande expérience des marchés financiers. Il a occupé plusieurs postes reliés aux investissements chez ING Gestion de placements et à la Banque Nationale. Par la suite, il s'est joint à iA Groupe financier de 2008 à 2019 où il occupait le poste de vice-président exécutif et chef des placements. Il était responsable de la gestion du fonds général de l'entreprise et des fonds de placement, ce qui totalisait 89 milliards de dollars au 31 décembre 2018. Il supervisera les aspects stratégiques de l'entreprise.

Également, il nous fait plaisir d'annoncer la nomination de Guillaume Beauregard en tant que chef de la conformité chez Evovest. Ses responsabilités viennent s'ajouter à celles de chef des opérations. Ce changement s'inscrit dans nos efforts afin de doter Evovest des meilleures pratiques de gouvernance et souligner l'apport important de Guillaume.

Notre processus d'investissement est toujours en évolution et des développements importants ont été mis en œuvre en juin. Afin d'avoir une capacité d'adaptation plus rapide aux marchés boursiers, nous sommes passés d'une base de données mensuelle à une base de données quotidienne. De plus, nous intégrons une gestion des risques explicite par le biais d'une prédiction conjointe du rendement excédentaire espéré et de sa volatilité. Enfin, un processus automatisé s'assure désormais du respect de la politique d'investissement des clients, facilitant ainsi la supervision humaine.

Pour terminer, nous mettons en place de nouvelles stratégies d'investissements. Il est désormais possible d'offrir des mandats sur mesure en relatif à des indices de référence choisis par le client ainsi que des mandats marchés neutres construits sur mesure parmi les géographies disponibles.

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

Actions mondiales

Avec la reprise depuis le début du trimestre, la stratégie s'est bien positionnée pour capturer le rebond boursier et mieux performer de +3.6%. Ceci se rajoute à la surperformance de cette stratégie, ce qui l'apporte à +5.6% vs son indice de référence sur une base annualisée depuis son lancement le 31 janvier 2019.

31 janv. 2019 - 30 juin 2020	Evovest	MSCI World EW Net
Rendements Annualisé	8.2%	2.6%
Volatilité Annualisée	16.7%	18.4%
Beta	0.87	1.00
Rendements T2 2020	18.0%	14.4%

Actions nord-américaines

Ayant légèrement battu son indice de référence en début d'année, la stratégie s'est bien positionnée pour capturer le rebond boursier. Elle a toutefois accusé un retard d'environ 1% au cours du dernier trimestre, portant à 7.4% la surperformance par rapport à son indice de référence sur une base annualisée depuis son lancement le 1er novembre 2018.

1 nov. 2018 - 30 juin 2020	Evovest	50% S&PTSX EW TR 50% S&P500 EW TR CAD
Rendements Annualisé	11.9%	4.4%
Volatilité Annualisée	23.3%	24.4%
Beta	0.80	1.00
Rendements T2 2020	24.0%	25.0%

Actions nord-américaines marché neutre

Le mandat actions nord-américaines marché neutre avait un rendement au 31 mai 2020 de –5.5% pour l'année 2020. En juin, notre processus s'est très bien adapté aux conditions de marchés changeantes pour profiter d'opportunités, pour un rendement de +9.6%. Depuis la création de la stratégie le 1er novembre 2018, elle annualise +5.9%.

1 nov. 2018 - 30 juin 2020	Evovest
Rendements Annualisés	5.9%
Volatilité Annualisée	9.0%
Beta	0.07
Rendements T2 2020	6.1%

Avertissement:

Les rendements présentés en CAD incluent les frais de transaction, mais excluent les frais de gestion et d'exploitation. Les rendements passés ne sont pas indicatifs des résultats futurs.