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.

Revue trimestrielle - T2 2021

Automatisation et amélioration des processus

Pour donner suite au démarrage d'un mandat institutionnel durant le dernier trimestre, beaucoup de nos efforts ont été tournés vers l'amélioration et l'établissement de nouveaux processus automatisés reliés aux divers éléments du cycle transactionnel. Ce travail nous permet d'avoir une base robuste pour notre croissance future et du même coup mettre en place une infrastructure qui nous permet d'avoir des rapports quotidiens transparents avec notre clientèle.

Avec ces efforts, nous visons également une efficience organisationnelle qui nous permet d'accomplir plus avec moins de ressources humaines que nos compétiteurs. C'est sous cette perspective que nous croyons pouvoir développer Evovest et offrir une offre de service compétitive.

Avancement scientifique

Nous aimerions également souligner le développement et l'intégration à nos modèles en production d'une nouvelle méthode d'apprentissage machine : des arbres décisionnels neuronaux, inspirés de travaux de recherche récents chez Yandex. Un esprit de développement continu est au cœur de notre processus en constante évolution.

Nous avons également amélioré notre contrôle du risque de portefeuille grâce à l'incorporation d'une mesure de corrélation. Il s'agit d'une première prise en compte explicite des dépendances entre les constituants du portefeuille. L'approche repose sur une mesure de distance basée sur nos facteurs de risques et est apparue compétitive relativement à des approches sophistiquées de factorisation matricielle. Nous en discutons dans une publication LinkedIn (lien).

Présence événementielle

Notons aussi la participation de Jérémie au panel fintech organisé par Finance Montréal ayant la question : Montréal peut-elle devenir un centre d'excellence en IA en finance et gestion d'actifs? Il y a élaboré sur les réalités d'Evovest en lien avec les défis rencontrés et les solutions appliquées.

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

Rendements - Actions mondiales

Le deuxième trimestre de 2021 a été en dessous de nos attentes avec un rendement inférieur à notre indice de référence de 0.5%. Après un rebond de la valeur ajoutée en avril, cette dernière s'est légèrement dégradée pendant le mois de mai et juin. Une des causes principales de cette sous-performance s'identifie par l'exposition à quelques titres en technologie aux États-Unis et de consommation au Japon qui ont sous-performé leurs pairs. À l'opposé, la sélection de titres industriels fut bénéfique pour la stratégie. Malgré tout, le rendement avant frais de la stratégie se compare favorablement depuis le début de l'année à 9.5% versus 8.9% pour l'indice de référence.

31 janv. 2019 - 30 juin 2021	Evovest	MSCI World EW Net
Rendements Annualisés	15.8%	12.0%
Volatilité Annualisée	14.6%	16.2%
Beta	0.81	N/A
Rendements T2 2021	3.7%	4.2%
Rendements année à ce jour	9.5%	8.9%

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.