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 - T3 2021

Annonce au sein de l'équipe

Beaucoup de changements sont survenus au sein d'Evovest au cours du dernier trimestre. Tout d'abord, nous accueillons deux nouveaux membres qui supporteront le développement de notre processus d'investissement et des technologies s'y rattachant.

Maxime a acquis une expérience professionnelle précieuse en travaillant chez CDPQ et KPMG. Son expertise en gestion des risques financiers, en ingénierie des données et en attribution de performance nous permettra de poursuivre le développement de notre infrastructure. De plus, poursuivant une certification CFA, il sera un atout pour le développement de divers aspects dans le processus de modélisation, ainsi que dans la construction de portefeuille. Il est diplômé de HEC avec un M. Sc. en ingénierie financière après avoir obtenu un B.Sc. en mathématiques à l'Université McGill. En 2021, il a obtenu son titre FRM.

Dong possède une grande expertise dans les développements technologiques et algorithmiques grâce à son expérience chez Moka Technologies. Sa solide formation mathématique lui permet d'être un atout sur le développement et l'adaptation d'algorithmes d'apprentissage machine chez Evovest. De plus, son expertise en systèmes informatiques servira bien l'équipe. Il est diplômé de l'Université Concordia avec une M.Sc. en mathématiques.

Terminons par souligner la transition de Jérémie Desgagné-Bouchard au titre de conseiller scientifique externe. Ce dernier continuera de nous partager ses connaissances et demeure sur notre conseil d'administration tout en poursuivant sa carrière.

Présence événementielle

Pendant le trimestre, Carl a participé à un panel composé d'autres membres du programme des gestionnaires en émergences du Québec pour souligner le 5e anniversaire de ce dernier.

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

Rendements - Actions mondiales

Le rendement de la stratégie s'élève à 1.9% comparativement à 1.7% pour notre référence. Bien que nous sommes légèrement au-dessus de notre indice de référence pour le trimestre, nous avons pu observer une contribution négative provenant d'une décision de construction de portefeuille. Faisant face à quelques contraintes reliées aux frais de transactions au Royaume-Uni et combiné à une confiance à la valeur ajoutée potentielle, nous avions réalloué une grande partie de ce poids de portefeuille à Hong Kong. Cette sur allocation nous a pénalisé de près de 0.5% sur le rendement du portefeuille, une décision qui sera évaluée dans les prochains mois. Du côté positif, nous avons bénéficié d'une surperformance provenant des titres américains et japonais.

31 janv. 2019 - 30 sept. 2021	Evovest	MSCI World EW Net
Rendements Annualisés	15.0%	11.4%
Volatilité Annualisée	14.1%	15.5%
Beta	0.81	N/A
Rendements T3 2021	1.9%	1.7%
Rendements année à ce jour	11.6%	10.8%

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.