Infolettre T3 - 2023

EVOVEST

Participation à l'ARASQ

Notre récente participation à la Conférence ARASQ qui s'est tenue à Gatineau en septembre dernier a fourni une plateforme exceptionnelle pour entrer en contact avec les régimes de retraite et présenter notre entreprise à un public plus large.

Tout au long de la conférence, nous avons engagé des discussions significatives avec des représentants de divers régimes de retraite. Nous avons présenté nos solutions innovantes et notre approche personnalisée qui distingue Evovest, en mettant l'accent sur notre capacité à les aider à optimiser leurs stratégies d'investissement et de planification financière.

Notre présence à la Conférence ARASQ nous a permis de nouer de nouvelles connexions et de renforcer les relations existantes. Nous anticipons avec enthousiasme les perspectives passionnantes qui ont découlé de cette conférence et continuerons à rechercher des opportunités de croissance et de collaboration dans les mois à venir.

Développements en R&D : Objectif par sous-univers

Pour lancer nos efforts, nous avons créé un modèle indépendant pour chaque sous-univers d'investissement, chacun ayant une tâche spécifique à accomplir grâce au processus d'apprentissage automatique.

Notre principal objectif était de modéliser les rendements excédentaires par rapport à la référence de chaque sous-univers. Nous avons pris en compte attentivement les contraintes opérationnelles, car un modèle unifié aurait considérablement compliqué le cycle de mise à jour des données, compte tenu des différences de fuseau horaire entre les pays asiatiques et nord-américains.

Bien que cette approche signifie que nos modèles ont été formés sur un ensemble de données plus restreint, elle offrait l'avantage de la diversification grâce à des interprétations de signaux légèrement différentes pour chaque sous-univers.

Au fur et à mesure que nous travaillions à unifier les modèles, nous avons dû concevoir plusieurs innovations de conception car le fait d'avoir une tâche commune pour tous les sous-univers présentait des défis.

Notre solution nous a permis de trader quotidiennement sans être contraints par le cycle de mise à jour des données, résolvant ainsi efficacement le problème de modélisation des rendements excédentaires pour chaque sous-univers.

De plus, l'incorporation de davantage de données dans les algorithmes a amélioré la précision de nos signaux d'investissement.

Infolettre T3 - 2023

EVOVEST

Opérations de swap

Au cours du troisième trimestre, nous avons accompli d'importants progrès opérationnels en intégrant des produits synthétiques d'actions pour une partie de notre exposition en dehors de l'Amérique du Nord pour notre stratégie alternative.

Cette intégration de l'équipe a non seulement amélioré notre efficacité opérationnelle, mais a également entraîné des économies de coûts pour nos clients. Cela illustre la capacité de notre équipe à intégrer des solutions innovantes pour gagner un avantage concurrentiel.

Commentaires trimestriels sur le marché

Au troisième trimestre de 2023, les actions mondiales ont connu un recul après un premier semestre solide. Les investisseurs avaient initialement de grands espoirs, croyant que la Réserve fédérale avait géré avec succès la transition de l'économie et la fin du resserrement monétaire. Cependant, ces attentes ont diminué en août et en septembre à mesure que se profilait la perspective de taux d'intérêt plus élevés à long terme.

Dans ce contexte, la stratégie **Evovest Actions Mondiales pondérée par capitalisation** a surpassé son indice de référence, enregistrant un rendement de 0,2 % par rapport à -1,9 %. Cette surperformance a été attribuée à une position défensive et à une exposition accrue aux actions à forte dynamique, tandis que l'impact négatif d'un biais en faveur des petites capitalisations au trimestre précédent s'est estompé. Les contributeurs positifs comprenaient Celestica, Kobe Steel et Alphabet, tandis que des positions sous-pondérées dans Apple, Tesla et ASML ont soutenu la performance.

Pendant ce temps, la stratégie **Evovest Marché Neutre Mondiales** a enregistré un rendement négatif de -0,8 % au T3, bénéficiant de positions courtes sur des actions à forte volatilité, mais cela n'a pas suffi à compenser le déclin global du marché. Les contributeurs positifs comprenaient des positions longues dans Babcock International Group et Kobe Steel, tandis que des positions courtes sur Apellis Pharmaceuticals et d'autres ont été bénéfiques.

Enfin, la stratégie ***Evovest Actions Mondiales Équipondéré*** a sous-performé son indice de référence avec un rendement de -2,8 %, principalement en raison d'une posture défensive lors d'un rebond en juillet. Malgré des contributions positives de certaines actions telles que Nvidia et Valero, des actions sous performantes comme FMC et Estee Lauder ont eu un impact plus significatif sur sa performance.

À PROPOS D'EVOVEST

Evovest est une société d'investissement basée à Montréal qui utilise des techniques axées sur les données et conçues par des humains pour gérer des portefeuilles d'actions. Fondée en 2017, Evovest a plus de 125 millions de dollars d'actifs sous gestion à travers des portefeuilles HNW et institutionnels gérés avec des modèles avant-gardistes et évolutifs. Sa mission est d'apporter de la diversification dans les stratégies actions grâce à un processus d'investissement innovant en utilisant l'IA et l'apprentissage automatique. La firme compte sept employés dans une structure rationalisée qui assure l'alignement des intérêts via la propriété. Evovest est certifiée B-Corp et s'efforce de créer un fort sentiment de communauté en promouvant la diversité et l'inclusivité dans l'ensemble de l'entreprise.

Entreprise B Certifiée

info@evovest.com

evovest.com