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 - T4 2020

La reprise des marchés boursiers s'est poursuivie durant le dernier trimestre de 2020, apportant les divers indices à des sommets historiques. Nous sommes heureux de voir la découverte d'un vaccin et l'impact positif que cette découverte aura sur la population. À la suite de l'annonce, nos stratégies ont cependant moins bien fait. Ceci peut se comprendre par la vulnérabilité inhérente associée aux approches analytiques lors de situations inédites. Les diverses mesures de gestion du risque dans le processus de construction du portefeuille permettent néanmoins d'en atténuer les potentiels effets négatifs. En outre, les stratégies ont enregistré dans les semaines suivantes des gains rattrapant l'essentiel des pertes subies.

À la suite d'une revue stratégique, nous avons décidé de fermer deux stratégies offertes en comptes ségrégués, soit actions nord-américaines et marché neutre nord-américain. Nous allons désormais nous concentrer sur la stratégie d'actions mondiales, offerte sous un fonds à notice d'offre, ainsi qu'une stratégie marché neutre d'actions mondiales qui sera lancée en 2021. Nous avons conclu que la mise en marché par le biais de comptes ségrégués n'était pas optimale pour un gestionnaire émergent comme Evovest et que les stratégies mondiales étaient mieux alignées avec les besoins du marché.

La gestion des stratégies nord-américaines a été une source importante d'apprentissages dont bénéficieront l'ensemble de nos activités. Nous tenons à remercier les clients et partenaires qui nous ont fait confiance. Nous fermons ces deux stratégies avec une valeur ajoutée positive de 3.5% pour la stratégie actions nord-américaines et un rendement de 1.0% pour la stratégie marché neutre nord-américain.

L'investissement responsable sans compromis

Durant le dernier trimestre, nous avons fait l'analyse de différents fournisseurs de données ESG. Nous sommes fiers d'annoncer que nous avons retenu les services de Truvalue Labs. Ils se sont distingués parmi plusieurs grâces à leur méthode de collecte de données et à la granularité de celles-ci.

L'évaluation des données s'est effectuée sur deux fronts. D'abord, nous voulions déterminer quels seraient les impacts de contraindre nos portefeuilles à un profil ESG supérieur à l'indice de référence. Également, nous cherchions à savoir si ces données permettaient d'améliorer la qualité de nos modèles prédictifs.

L'intégration de contraintes sur les considérations ESG, résultant en un score de matérialité 10% supérieur à l'indice de référence, a montré de légers effets négatifs sur notre alpha simulé historique. Cependant, cet effet s'est révélé pleinement compensé par le signal supplémentaire que les informations ESG apportent à nos modèles prédictifs.

L'effet net est un portefeuille responsable sans compromis sur la performance. Dans les prochains mois, nous mettrons en place ces mesures ESG de manière à intégrer l'investissement responsable à tous nos produits.

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

Rendements - Actions mondiales

Le rendement du quatrième trimestre 2020 a été légèrement inférieur (0.2%) à notre indice de référence. Le positionnement du portefeuille au moment de l'annonce de la découverte d'un vaccin explique l'essentiel de cette sous-performance. Malgré tout, nous avons été en mesure de rattraper une grande partie de ce retard durant le mois de décembre. L'année se termine avec une valeur ajoutée de +8.4% pour 2020.

31 janv. 2019 - 31 déc. 2020	Evovest	MSCI World EW Net
Rendements Annualisés	14.9%	10.4%
Volatilité Annualisée	15.3%	17.6%
Beta	0.80	N/A
Rendements T4 2020	12.3%	12.5%
Rendements 2020	16.2%	7.8%

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.