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 2022

Une année transitoire s'est terminée. Nous avons pu l'observer avec la fin des restrictions sanitaires et où l'impact de l'inflation a créé une incertitude économique qui a pesé sur les actifs boursiers et obligataires. La plupart des portefeuilles traditionnels sont en forte baisse pour 2022.

Nous sommes particulièrement fiers d'avoir été en mesure de protéger le capital de nos clients durant la dernière année. Le rendement brut de la stratégie d'actions mondiales équipondérées est de -0.9% pour 2022, une surperformance importance comparativement à notre indice de référence qui se voit terminer l'année à -10.9%. Sur les 3 dernières années, le rendement annualisé brut s'élève à 10.9% comparativement à 3.0%. Pour ceux et celles qui nous font confiance depuis le début, nous vous remercions d'avoir été présent et d'avoir cru en nous. Evovest demeure dédié à évoluer pour continuer de vous offrir une source unique de rendements.

Un nouveau membre dans l'équipe

Beaucoup de projets sont en cours pour 2023. L'arrivée de Vanessa Vega Miranda dernièrement nous permet de nous doter d'aptitudes complémentaires en gestion et marketing. Celle-ci se joint à nous après un parcours qui comprend des expériences chez Walmart et Foodology, et l'obtention d'un MBA à IE Business School de Madrid. Vous allez certainement avoir la chance d'interagir avec cette dernière prochainement.

Nouveau produit

Pour poursuivre l'institutionnalisation, un des éléments importants est d'offrir des produits qui sont comparables aux autres. C'est avec plaisir que nous vous informons qu'au mois d'octobre 2022, nous avons migré le mandat du PGEQ vers un indice de référence pondéré avec la capitalisation boursière des entreprises. Ce changement s'inscrit dans l'évolution constante et démontre l'adaptabilité de notre processus. Désormais, la construction de portefeuille s'opère avec des poids relatifs à l'indice de référence et nous permet de faire de petites déviations actives géographiques. Bientôt, vous pourrez trouver l'information de ces rendements sur notre site web.

Un récapitulatif sur 2022

Dans le cadre du mandat qui nous a été confié par le PGEQ, la décision de modifier l'indice de référence a été prise. Beaucoup de travail a été effectué par notre équipe d'investissement pour adapter nos modèles à un indice de référence pondéré en fonction de la capitalisation boursière. Ce changement prendra effet à partir du 4^{e} trimestre. Nous tenons aussi a remercié l'équipe du PGEQ de nous avoir démontré sa confiance en augmentant l'allocation cible à la stratégie actions mondiales d'Evovest dans le Fonds traditionnel PGEQ.

Projets de recherches pour 2023

Pour 2023, nous déployons une nouvelle architecture de recherche qui nous permettra d'être plus efficients et d'itérer plus rapidement sur des idées d'amélioration du processus d'investissement. Également, les nouvelles ressources seront dédiées à l'intégration de nouvelles données pour améliorer la précision du signal de rendements excédentaires.

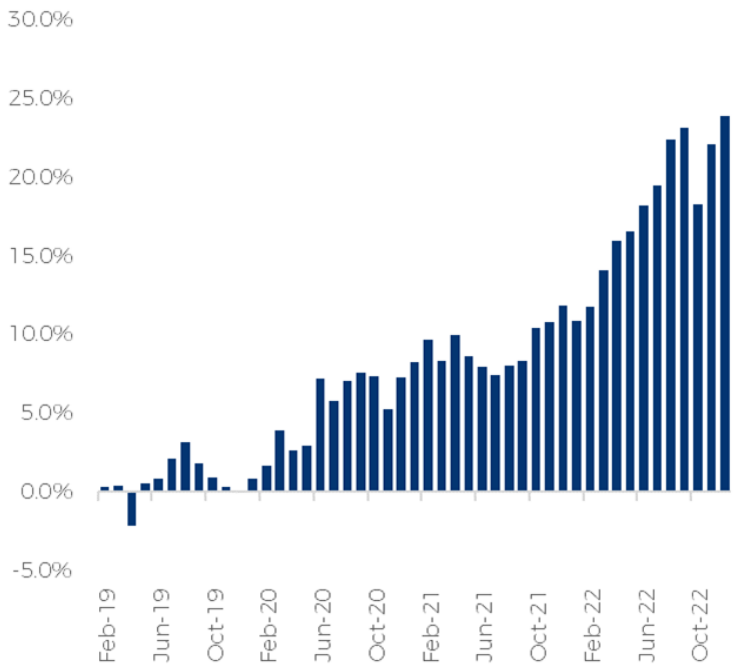
Pour terminer, une révision importante de notre vision ESG sera entamée avec l'aide de Tamara Close, membre du conseil d'administration.

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.

Rendements - Actions mondiales équipondérées

Le dernier trimestre de 2022 s'est avéré volatil pour la stratégie d'actions mondiales. Le mois d'octobre fut celui où la stratégie a le moins bien performé en 2022. Cependant, il fut suivi en novembre par la meilleure performance de l'année. Cela s'explique principalement par le fait qu'à partir de septembre, une sous-pondération au facteur momentum s'est établi. Cela était légèrement trop tôt, puisque ce facteur a continué de performer jusqu'à un sommet des dernières années. Ce positionnement a en revanche été bénéfique en novembre, étant donné que le momentum a connu une forte correction. L'année s'est finalement conclue sur un mois de décembre moins volatile au niveau de l'alpha, mais tout de même surperformant. Il est à noter que ces choix de positionnement étaient visibles dans notre outil d'IA explicatif, accordant une forte importance à la volatilité, au momentum et aux facteurs macroéconomiques.

Alpha Cumulé Réalisé



31 janv. 2019 - 31 déc. 2022	Evovest	MSCI World EW Net
Rendements Annualisés	11.4%	5.4%
Alpha annualisé	6.0%	N/A
Volatilité Annualisée	14.1%	15.0%
Beta	0.87	N/A
Rendements T4 2022	11.9%	11.2%
Erreur de réplication	5.1%	N/A

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.