

Objectif de placement

L'objectif d'investissement du fonds est la génération de rendements excédentaires par rapport à l'indice de référence, le MSCI World Equal Weighted Index, un portefeuille équilibré des plus grandes capitalisations des économies développées sur un cycle boursier complet. La stratégie d'investissement du conseiller en négociation repose sur l'automatisation et l'amélioration du processus d'investissement fondamental d'un gestionnaire de portefeuille à l'aide de l'intelligence artificielle («IA»). La société en commandite investira dans des titres de participation, comme des actions ordinaires, et sera exposée aux marchés développés mondiaux.

Site Web

www.evovest.com

Stratégie / Devise

Actions globales / CAD

Indice de référence

MSCI World Equally-Weighted Index

Date de lancement

18 mars 2021

Actifs sous gestion

37 384 804\$

Frais de gestion

0.40%

Gestionnaire de fonds/Courtier sur le marché dispensé

Gestion de placements Innocap Inc.

Administrateur

Apex

Gardien de valeur

Northern Trust

Contacts

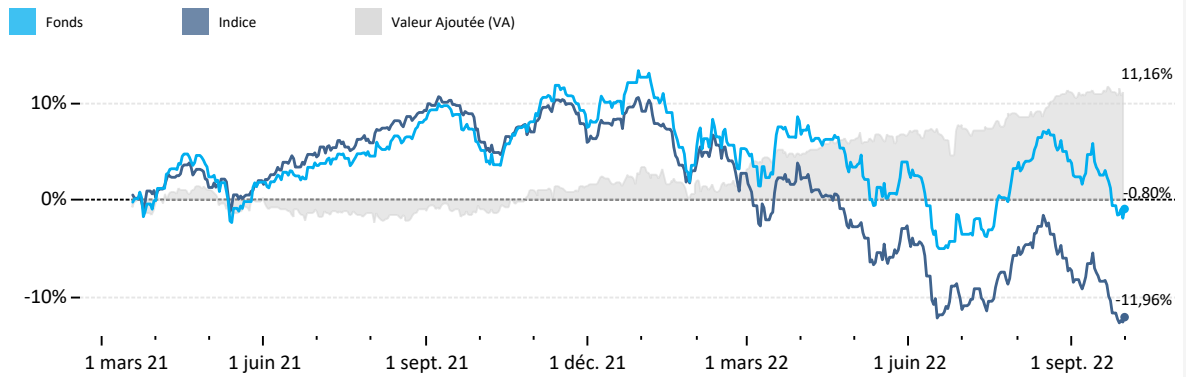
Innocap

Caroline Bergeron | Relations Investisseurs
(514) 390-5740
caroline.bergeron@innocap.com

PGEQ

Carolyn Cartier-Hawrish | Directrice
(514) 242-8832
carolyn.cartier-hawrish@pgeq.com

Évolution de la valeur liquidative unitaire, l'indice de référence et la valeur ajoutée



Rendement brut et année à date

	janv.	févr.	mars	avr.	mai	juin	juil.	août	sept.	2022
Fonds	-6,33%	-0,28%	1,46%	-3,16%	-0,49%	-6,23%	7,02%	0,54%	-4,55%	-12,05%
Indice	-4,84%	-1,08%	-0,59%	-4,79%	-1,18%	-7,68%	6,28%	-1,65%	-5,17%	-19,43%
VA	-1,49%	0,79%	2,05%	1,63%	0,69%	1,45%	0,74%	2,20%	0,62%	7,39%

Rendement annuel brut

	2021
Fonds	12,79%
Indice	9,27%
VA	3,51%

Rendement depuis la création

	3M	12M	24M*	36M*	5A*	DC*
Fonds	2,70%	-6,11%	-0,52%	-0,52%	-0,52%	-0,52%
Indice	-0,88%	-17,13%	-7,95%	-7,95%	-7,95%	-7,95%
VA	3,59%	11,02%	7,43%	7,43%	7,43%	7,43%

*Les rendements 24 mois, 36 mois, depuis création et la volatilité sont annualisés lorsque applicable

Détails depuis la création

Pire perte cumulée	-16,65%
Meilleur mois	6,91%
Pire mois	-6,42%
% des mois positifs	52,63%
% des mois négatifs	47,37%
Volatilité*	12,54%
Beta	0,94
Sharpe	0,02

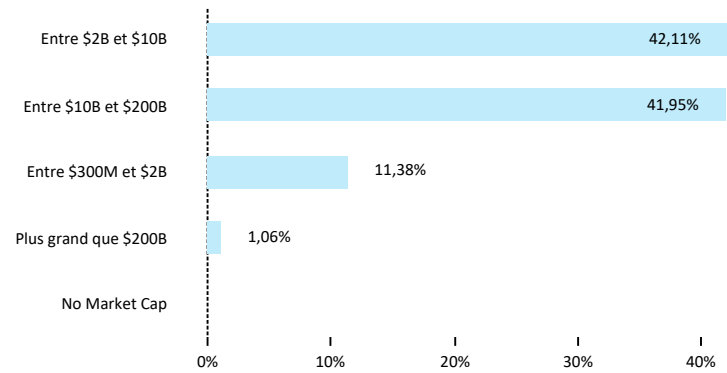
Les expositions excluent les positions d'encaisse et de devises si applicable

VaR

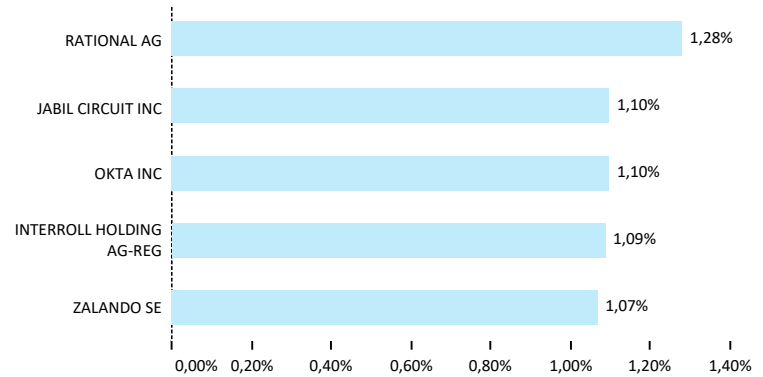
Distincte

Incrémentale

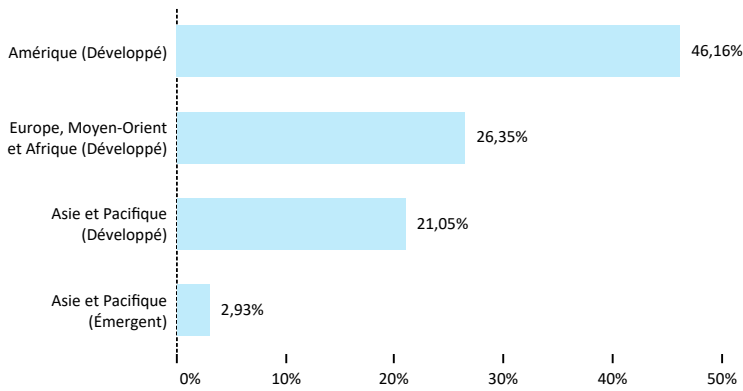
Exposition par Capitalisation Boursière



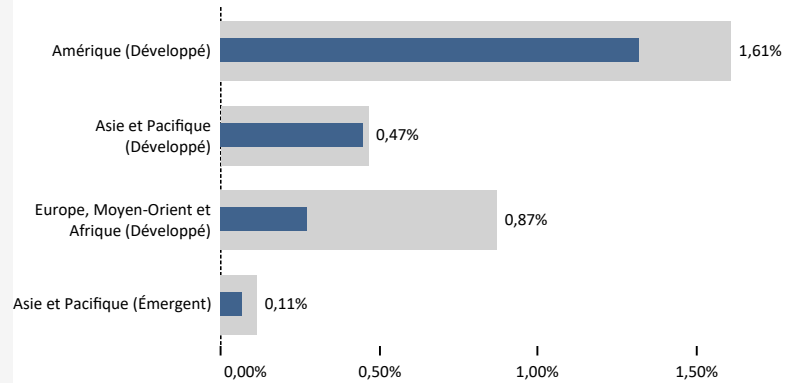
Top 5 exposition par instrument



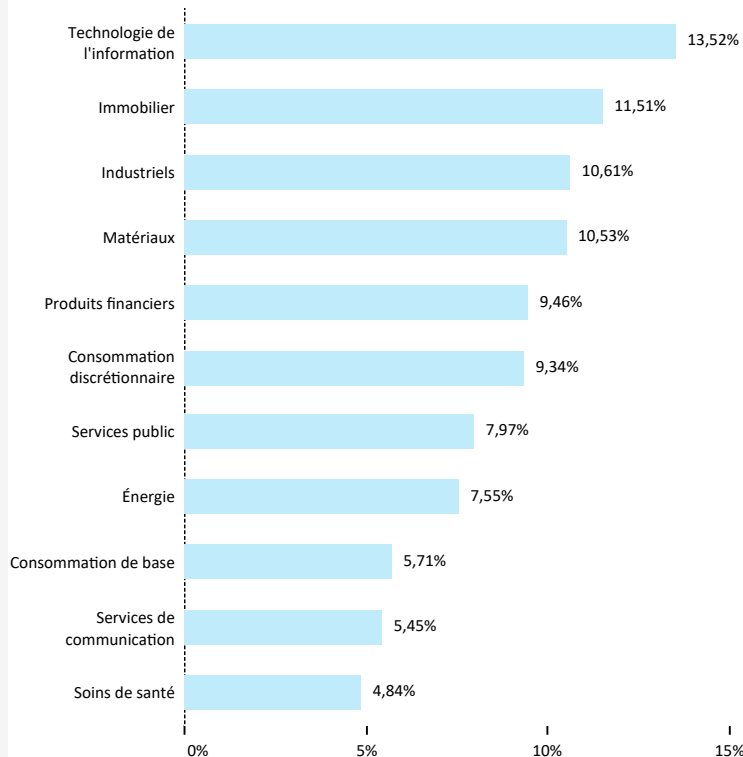
Exposition par zone géographique



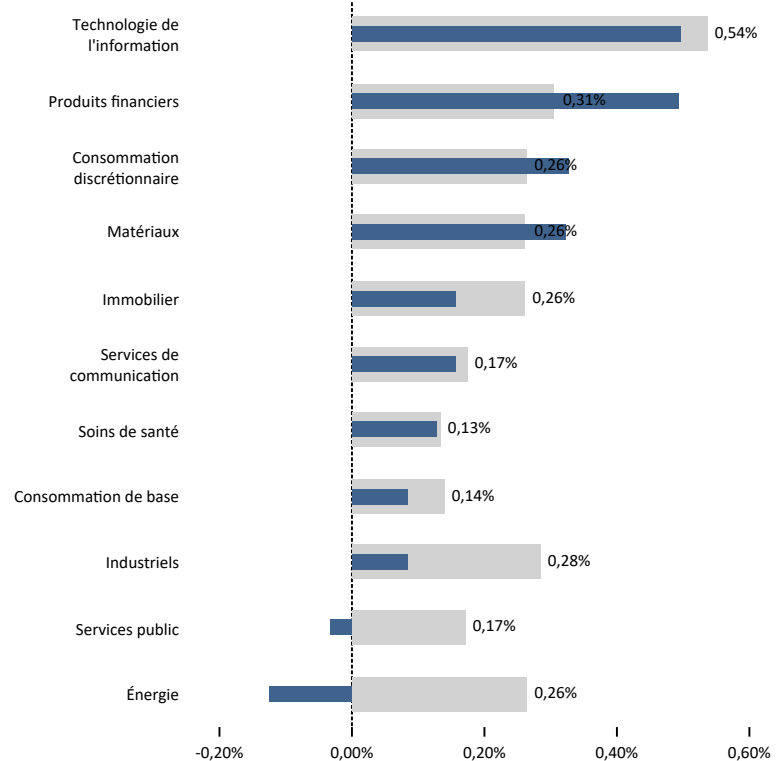
VaR par zone géographique



Exposition par secteur



VaR par secteur



Source : Innocap

Les expositions excluent les positions d'encaisse et de devises si applicable

Commentaire du gestionnaire

Un autre trimestre mouvementé vient de s'achever. Ce ne fut pas un été de tout repos avec les marchés mondiaux qui ont tenté une reprise de la mi-juillet à la mi-août, pour reprendre leur tendance baissière par la suite. Les banques centrales n'ont quant à elles pas pris de pause et ont continué d'augmenter les taux directeurs pour s'attaquer à l'inflation. Malgré ces conditions de marchés difficiles, nous avons pu créer de la valeur relativement à notre indice de référence. Malgré l'environnement de marché mentionné précédemment, nos modèles ont su bien se positionner pour ajouter de la valeur. Durant la première moitié du trimestre, la stratégie a sous-pondéré de manière croissante l'exposition aux titres à haut Beta au fur et à mesure que les marchés mondiaux augmentaient. Bien que ceci ait retranché de la valeur durant cette période, la sélection de titres a amplement compensé pour ce positionnement. Il est d'ailleurs à noter que bien que l'exposition moyenne au facteur Beta était négative, le titre ayant le mieux performé dans le portefeuille sur le trimestre, Coinbase, est un titre à haut Beta. Celui-ci, comme expliqué par notre outil d'intelligence artificielle explicative, fut acheté sur une courte période pour ses caractéristiques techniques de momentum à court terme et d'activité transactionnelle. Dans la deuxième moitié du trimestre, ce fut l'exposition factorielle qui fut bénéfique à la valeur ajoutée, entre autres en raison de la sous-pondération importante au facteur Beta. L'effet de sélection, lui, n'ajouta ni ne retrancha de valeur pendant cette période.

Source : Gestionnaire

Avis important

La présente publication est confidentielle et n'est destinée qu'à votre utilisation personnelle. Elle ne peut être reproduite ou redistribuée, en tout ou en partie, en aucun cas sans l'accord préalable écrit de Gestion de placements Innocap inc. («Innocap»). Innocap croit que l'information divulguée dans cette publication est fiable, mais ne peut en garantir la fiabilité ou l'exhaustivité et ne pourrait être tenue responsable de tout préjudice, direct ou indirect, subi à la suite de leur utilisation. L'information et les opinions incluses dans cette publication le sont à titre informatif seulement et pourraient varier selon les conditions de marché et la conjoncture sur lesquelles elles se basent. Cette publication ne doit pas être considérée comme une sollicitation visant l'achat ou une offre visant la vente de valeurs mobilières ou de tout autre produit ou service, adressée à toute personne résidant dans une juridiction où une telle sollicitation ou offre serait prohibée en vertu des lois qui s'y appliquent. La performance passée n'est pas un indicateur fiable de la performance future. La valeur des investissements et de leurs revenus peut diminuer ou augmenter. Vous pourriez ne pas récupérer le montant que vous avez investi. Veuillez consulter la documentation d'offre du fonds avant d'effectuer tout investissement. Les termes clés qui sont utilisés dans ce document sans y être définis ont le sens prévu dans la documentation d'offre.