

Aperçu d'AGFiQ

AGFiQ est une plateforme d'investissement quantitatif qui bénéficie d'une équipe pluridisciplinaire aux compétences variées, réunissant des professionnels de l'investissement. AGFiQ offre de l'expertise dans la gestion d'actifs au moyen de stratégies d'investissement factoriel fondées sur des règles, qui comprennent des actifs aussi bien traditionnels que non traditionnels avec divers risques et objectifs de rendement.

Philosophie et démarche

La philosophie et la démarche d'investissement quantitatif d'AGFiQ reposent sur la conviction que les résultats d'investissement peuvent être améliorés par l'évaluation et le ciblage des facteurs qui influencent les rendements des marchés. Conformément à cette philosophie, l'équipe a pour objectif de procurer de meilleurs rendements rajustés selon le risque, en assemblant des portefeuilles innovants. Un processus rigoureux, transparent et reproductible¹, guidé par des facteurs exclusifs et des modèles fondés sur le risque, permet de répartir l'actif de façon judicieuse et avisée, afin d'atteindre les objectifs d'investissement fixés.

Expertise

Notre expertise se traduit par des solutions d'investissement factoriel fondées sur des règles, et faisant appel à des actifs traditionnels et non traditionnels. L'équipe d'AGFiQ gère des stratégies fondées sur des facteurs pour un vaste éventail d'investisseurs institutionnels, et elle est responsable, à titre de conseiller en placements, de certains FNB et fonds communs de placement multifactoriels. L'équipe dispose de l'expertise et de l'infrastructure nécessaires en matière d'exploitation pour gérer des mandats élargis, quels que soient les catégories d'actifs et les instruments utilisés. À titre de stratégestes spécialisés dans le domaine des FNB, l'équipe d'AGFiQ assemble des portefeuilles gérés d'après des modèles factoriels exclusifs qui sont appliqués à l'ensemble des catégories d'actifs.

Équipe d'investissement

L'équipe d'AGFiQ réunit 18 professionnels spécialisés dans le domaine de l'investissement factoriel.

Équipe AGFiQ –
quelques faits
en chiffres

200+ années
d'expérience

6 titulaires de
doctorats²

10 analystes
financiers agréés
(CFA®)

13 titulaires de
maîtrises

¹ S'applique au processus de sélection des investissements seulement et non aux résultats ou aux rendements.

² Titulaires dans les domaines de l'astrophysique, de l'informatique, de la finance et de l'économie.

Stratégies à bêta stratégique

Stratégie	Objectif d'investissement	Positionnement	Rendement
Revenu de dividendes avec couverture AGFiQ	Stratégie conçue pour produire un rendement courant élevé et offrir une plus-value du capital avec un profil de risque semblable à celui d'un indice d'obligations de sociétés. Cette stratégie se situe au croisement de la croissance, du revenu et des actifs non traditionnels.	Actions américaines à dividendes Revenu non traditionnel	Visé à obtenir des résultats conformes au cours et au rendement ¹ de l'indice INDXX Hedged Dividend Income.
Neutre par rapport au marché Facteur « anti-bêta » AGFiQ	Stratégie neutre par rapport au marché qui investit dans des actions américaines afin de fournir une exposition à l'écart de rendement entre les actions à coefficient de bêta faible et celles de bêta élevé.	Actions américaines Neutre par rapport au marché, axé sur un seul facteur Couverture d'actions	Visé à obtenir des résultats conformes au cours et au rendement de l'indice Dow Jones U.S. Thematic Market Neutral Anti-Beta.

¹ Avant déduction des frais et des dépenses.

Stratégies Portefeuilles gérés

Stratégie	Objectif d'investissement	Positionnement	Rendement
FNB de base à rendement absolu AGFiQ	Stratégie de rendement absolu qui investit dans des positions longues ou courtes, des FNB axés sur un seul facteur et les positions longues et des FNB à revenu fixe. Elle vise à offrir une volatilité inférieure, ainsi qu'une corrélation avec les actions et les titres à revenu fixe.	Multicatégorie Rendement absolu Stratégie non traditionnelle liquide/ objectif de fonds de couverture	Trésorerie + 4-6 %
Couverture d'actions AGFiQ	Exposition aux actions américaines et gestion du risque en ayant recours à une méthode d'investissement multifactorielle et à une couverture stratégique des actions pour aider à gérer la volatilité, les baisses et les événements de risque.	Actions américaines Neutre par rapport au marché, axé sur un seul facteur Couverture d'actions	Gestion du risque Indice de RG S&P 500
Répartition multicatégorie de revenu AGFiQ	Stratégie composée de positions longues uniquement qui investit dans diverses catégories d'actifs et dont le mandat explicite est le rendement.	Multicatégorie Revenu	Indice agrégé Barclays + 2-4 %

Expertise axée sur la personnalisation

AGFiQ, qui est fière d'orienter ses discussions vers l'investisseur, élabore des stratégies dans le but de proposer des solutions innovatrices adaptées aux objectifs de la clientèle. Voici certains des thèmes abordés : exposition aux facteurs, indicateur de déviation souhaité; ainsi que des contraintes applicables : rotation, secteur/industrie, taille et titre, modélisation du risque optimisé, fréquence de rééquilibrage, considérations ESG.

Pour plus de détails sur AGFiQ, y compris l'éventail complet de solutions d'investissement pour les investisseurs institutionnels, visitez le site AGFiQ.com ou communiquez avec votre directeur des relations AGF.

La société AGFiQ Gestion de l'actif (AGFiQ) représente une collaboration entre des professionnels de l'investissement issus des sociétés Gestion de placements Highstreet (gestionnaire de portefeuille inscrit au Canada) et FFCM, LLC (conseiller inscrit aux États-Unis). Cette collaboration constitue l'équipe d'investissement quantitatif. Le présent document ne peut être ni reproduit (en entier ou en partie), ni transmis, ni rendu accessible à toute autre partie, sans le consentement préalable écrit de Placements AGF Inc., FFCM, LLC et Gestion de placements Highstreet. Les commentaires que renferme le présent document sont fournis à titre de renseignements d'ordre général fondés sur des informations disponibles au 10 août 2018 et ne devraient pas être considérés comme des conseils personnels en matière de placement, une offre ou une sollicitation d'achat ou de vente de valeurs mobilières. Nous avons pris les mesures nécessaires pour nous assurer de l'exactitude de ces commentaires au moment de leur publication, mais cette exactitude n'est pas garantie. Les conditions du marché peuvent changer et le gestionnaire de portefeuille n'accepte aucune responsabilité pour des décisions de placement prises par des individus et découlant de l'utilisation ou sur la foi des renseignements contenus dans le présent document. Les FNB AGFiQ sont des fonds négociés en bourse (FNB) offerts par Placements AGF Inc. et gérés par Gestion de placements Highstreet. Les FNB AGFiQ sont inscrits et négociés sur des marchés publics organisés du Canada. On peut acheter ou vendre des parts de ces FNB uniquement par l'entremise d'un courtier autorisé.

Le présent document est réservé à l'usage exclusif d'investisseurs qualifiés. Date de publication : le 27 août 2018.