

La stratégie de momentum EAEO de Lazard Asset Management, LLC ajoute une approche de momentum au Fonds d'actions internationales SEI Canada.



Février 2023

La stratégie de momentum EAEO de Lazard Asset Management LLC a été ajoutée au Fonds d'actions internationales SEI Canada.

Philosophie et processus de placement

Le processus de Lazard est quantitatif et incorpore deux séries de facteurs : le sentiment (momentum) et la qualité. La stratégie vise principalement à tirer parti des facteurs de momentum, dont les révisions des estimations des analystes, le momentum résiduel des prix et les effets de retournement. Une partie du modèle est également pondérée par des facteurs de qualité.

La stratégie est composée de 200 à 300 actions et son roulement est élevé. L'équipe gère pour nous un mandat similaire depuis 2017, d'où notre confiance et notre familiarité avec l'équipe et l'approche.

Rôle dans le Fonds

La stratégie de Lazard offre une exposition constante au momentum de la source d'alpha. Nous nous attendons à ce que la stratégie obtienne des résultats supérieurs au cours des périodes pendant lesquelles la source d'alpha surperforme ou, plus précisément, lorsque les thèmes du marché sont persistants. Elle sera mise à l'épreuve pendant les périodes de perturbations dans les marchés lorsque l'établissement des tendances est difficile.

À propos de Lazard

Établie en 1970 et basée à New York, Lazard Asset Management LLC est une société de gestion de l'actif mondiale avec des bureaux dans huit pays. Au 1^{er} décembre 2022, la société avait 171 milliards de dollars d'actifs sous gestion.

Pourquoi nous aimons Lazard

- **Gestionnaires de portefeuille chevronnés** : Nous croyons que les gestionnaires de portefeuille de l'équipe sont chevronnés et avisés.
- **Expérience avec l'approche** : Lazard gère une stratégie similaire pour SEI depuis 2017, ce qui lui a permis d'améliorer le processus au fil du temps.
- **Exposition constante au momentum** : Le processus est quantitatif, et donc hautement répétable.

Renseignements importants

Société de placements SEI Canada, filiale en propriété exclusive de SEI Investments Company, est le gestionnaire des Fonds SEI au Canada.

Les informations fournies le sont à titre d'information générale et d'éducation uniquement et ne constituent pas un avis juridique, fiscal, comptable, un conseil financier ou de placement à propos des Fonds ou de tout titre en particulier, ni une opinion à l'égard de la pertinence d'un placement. Les informations ne devraient pas non plus être interprétées comme une recommandation quant à l'achat ou à la vente d'un titre, d'un produit dérivé ou d'un contrat à terme. Il n'est pas recommandé d'agir en fonction de l'information contenue dans ce document, à moins d'obtenir expressément un avis juridique, fiscal, comptable et financier auprès d'un professionnel en placement.

Le présent document est une évaluation de la situation des marchés à un moment précis et ne constitue pas une prévision d'événements à venir ou une garantie de rendements futurs. Les pondérations en pourcentage des fonds sous-jacents peuvent être modifiées de temps à autre à la discrétion du gestionnaire. De temps à autre, le gestionnaire peut, à sa discrétion, remplacer un gestionnaire de portefeuille ou revoir la répartition des actifs entre les gestionnaires.

Des commissions, commissions de suivi, frais de gestion et autres frais peuvent être associés aux fonds communs de placement. Veuillez lire le prospectus avant d'investir. Les fonds communs de placement ne sont pas garantis, leurs valeurs fluctuent fréquemment et leurs rendements passés pourraient ne pas se reproduire.