

COMMUNIQUÉ DE PRESSE

Londres, le 9 juillet 2024

Lombard Odier Investment Managers lance la stratégie DataEdge Market Neutral

La stratégie utilise le Big Data relatif aux tendances de consommation afin d'identifier les surprises liées aux bénéfices et d'exploiter le potentiel d'alpha.

Lombard Odier Investment Managers (« LOIM ») annonce aujourd'hui le lancement de sa stratégie DataEdgeMarket Neutral et axée sur les placements alternatifs. Cette stratégie combine l'analyse du Big Data et l'expertise en matière d'investissement systématique pour identifier les tendances qui caractérisent le comportement des consommateurs et leur incidence sur les prévisions de bénéfices des entreprises, afin de saisir les opportunités d'alpha au profit des investisseurs.

La stratégie DataEdge de LOIM est une stratégie d'actions market neutral, dotée d'un cadre d'investissement unique capable de déceler le potentiel d'alpha en appliquant un « avantage informationnel » à la sélection de titres.

Lancée il y a trois ans, elle est proposée pour la première fois aux investisseurs externes, sous la forme d'un OPCVM.

La stratégie repose sur l'analyse de points de données alternatifs, dans divers secteurs, sources et régions géographiques, y compris les transactions par carte de crédit, les reçus digitaux, le trafic en ligne, l'activité sur les applications et les services de géolocalisation. Ces données sont structurées et filtrées pour identifier, en temps réel, les tendances qui caractérisent le comportement des consommateurs.

Des méthodes d'analyse systématique et quantitative sont ensuite appliquées pour prédire l'incidence potentielle de ces tendances sur les indicateurs clés de performance (*Key Performance Indicators* ou KPIs) des sociétés cotées, tels que les ventes, les revenus et le nombre de nouveaux clients, ainsi que pour suivre les points d'inflexion des tendances relatives aux KPI sur plusieurs trimestres. Cet « avantage informationnel » améliore les prévisions de résultats des entreprises, ce qui permet de mieux prédire les surprises en matière de bénéfices et de saisir le potentiel d'alpha.

L'univers d'investissement est actuellement centré sur les Etats-Unis et met l'accent principalement sur les petites et moyennes entreprises des secteurs de la consommation, de la technologie, de l'industrie et de la santé. La stratégie suit près de 700 entreprises chaque jour afin de construire un portefeuille à contre-courant et diversifié de 200 à 250 titres actifs, dont les résultats pourraient selon nous s'écarter des prévisions du marché, générant ainsi un potentiel d'alpha.



LOMBARD ODIER
INVESTMENT MANAGERS

La stratégie DataEdge est gérée par deux cogérants principaux, Laurent Joué et Marc Pellaud. Combinant 36 années d'expérience dans les stratégies alternatives systématiques, ils travaillent en étroite collaboration avec l'équipe d'investissement quantitatif qui compte 21 professionnels et gère plus de USD 10 milliards d'actifs.

Jean-Pascal Porcherot, Co-responsable de LOIM et Associé-gérant du Groupe Lombard Odier, déclare : « La stratégie DataEdge est un ajout important à la gamme de stratégies de *hedge funds* de LOIM. Elle souligne la profondeur des compétences et de l'expertise propres à nos produits d'investissement systématique, et reflète notre volonté de trouver de nouvelles façons de générer de l'alpha dans toutes les classes d'actifs. DataEdge combine des processus d'investissement testés et approuvés avec de nouvelles sources de données, afin d'offrir aux investisseurs une stratégie neutre par rapport au marché et unique en son genre, ainsi qu'un potentiel de rendement attractif. »



A propos de Lombard Odier IM

Lombard Odier Investment Managers est la société de gestion d'actifs institutionnels du Groupe Lombard Odier, groupe bancaire entièrement détenu et financé par ses Associés-gérants depuis sa création en 1796.

Nous proposons une gamme de solutions d'investissement à un groupe varié de clients axés sur des perspectives de long terme. Notre héritage et notre capacité à combiner tradition et innovation nous permettent de créer de la valeur à long terme pour nos clients. Notre expertise de gestion s'étend à de nombreuses classes d'actifs : les obligations, les convertibles, les actions, la gestion diversifiée et les produits alternatifs. La durabilité est absolument essentielle à notre philosophie d'investissement. Nous la considérons comme le fondement des résultats économiques et financiers et pensons qu'elle permettra d'apporter des rendements intéressants sur le long terme.

Avec 209 professionnels de l'investissement répartis dans treize bureaux à travers le monde (Europe, Asie et Amérique du Nord), nous proposons un dispositif international complet, dont les actifs sous gestion s'élevaient au 31 décembre 2023 à USD 70 milliards.

Pour plus d'informations : www.am.lombardodier.com

Celeste Herriger

Head of PR, Lombard Odier Investment Managers

+41 (0) 44 214 1426

C.Herriger@lombardodier.com

Informations importantes :

Le présent document a été publié par Lombard Odier Asset Management (Europe) Limited, société autorisée et réglementée par la Financial Conduct Authority (FCA) et enregistrée sous le numéro 515393 dans le registre de la FCA. Lombard Odier Investment Managers (« LOIM ») est un nom commercial.

Ce document est fourni à titre d'information uniquement et ne constitue pas une offre ou une recommandation d'acheter ou de vendre un titre ou un service quelconque. Il n'est pas destiné à être distribué, publié ou utilisé dans une juridiction où une telle distribution, publication ou utilisation serait illégale. Ce document ne contient pas de recommandations ou de conseils personnalisés et n'est pas destiné à remplacer un quelconque conseil professionnel sur l'investissement dans des produits financiers. Avant d'effectuer une quelconque transaction, il est conseillé à l'investisseur de vérifier minutieusement si elle est adaptée à sa situation personnelle et, si nécessaire, d'obtenir un avis professionnel indépendant quant aux risques et aux conséquences juridiques, réglementaires, fiscales et comptables, ainsi qu'en matière de crédit. Le présent document est la propriété de LOIM et est adressé à son destinataire pour son usage personnel exclusivement. Il ne peut être reproduit (en partie ou dans son intégralité), transmis, modifié ou utilisé dans un autre but sans l'accord écrit préalable de LOIM. Ce document contient les opinions de LOIM, à la date de publication.

Ni le présent document ni aucune copie de ce dernier ne peuvent être envoyés, emmenés ou distribués aux Etats-Unis, dans l'un de leurs territoires, possessions ou zones soumises à leur juridiction, ni à une Personne américaine ou dans l'intérêt d'une telle personne. A cet effet, l'expression « Personne américaine » désigne tout citoyen, ressortissant ou résident des Etats-Unis d'Amérique, toute association organisée ou existant dans tout Etat, territoire ou possession des Etats-Unis d'Amérique, toute société organisée en vertu des lois des Etats-Unis ou d'un Etat, d'un territoire ou d'une possession des Etats-Unis, ou toute succession ou tout trust dont le revenu est imposable aux Etats-Unis, quelle qu'en soit l'origine.

Source des chiffres : sauf indication contraire, les chiffres mentionnés ont été préparés par LOIM.

Bien que certaines informations aient été obtenues de sources publiques réputées fiables, sans vérification indépendante, nous ne pouvons garantir leur exactitude et exhaustivité.

Les avis et opinions exprimés le sont uniquement à titre d'information et ne constituent pas une recommandation de LOIM d'acheter, de vendre ou de détenir un titre quelconque. Les avis et opinions sont actuels à la date de cette présentation et sont susceptibles de changer. Ils ne doivent pas être interprétés comme des conseils en investissement.

Aucune partie de ce document ne saurait être (i) copiée, photocopiée ou reproduite sous quelque forme et par quelque moyen que ce soit, ou (ii) distribuée à toute autre personne qu'un employé, cadre, administrateur ou agent autorisé du destinataire sans l'accord préalable de Lombard Odier Asset Management (Europe) Limited. Au Royaume-Uni, ce document constitue une promotion financière et a été approuvé par Lombard Odier Asset Management (Europe) Limited, qui est autorisée et réglementée par la FCA.