

## Objectif de placement

Le Fonds Rivemont rendement absolu a comme objectif d'offrir aux investisseurs des rendements positifs dans toutes les conditions de marché, tout en maintenant une faible corrélation avec les classes d'actifs traditionnelles telles que les actions et les obligations. De plus, le fonds vise à préserver le capital lors de marchés baissiers tout en conservant un potentiel de rendement élevé lors de marchés haussiers.

## Aperçu

|                    |                              |
|--------------------|------------------------------|
| Date de création   | 1 <sup>er</sup> janvier 2013 |
| Stratégie          | Actions acheteur/vendeur     |
| Style de gestion   | Technique et tendance        |
| Actifs du fonds    | 6 millions \$                |
| Actifs de la firme | 45 millions \$               |

## Codes Fundserv

|         |        |
|---------|--------|
| Série A | MAJ700 |
| Série B | MAJ704 |
| Série F | MAJ701 |

## Profil rendement-risque

|  |                |
|--|----------------|
| Rendement net annualisé (depuis la création) | <b>6,4 %</b>   |
| Écart-type annualisé                         | <b>15,0 %</b>  |
| Ratio Sharpe annualisé                       | <b>0,45</b>    |
| Corrélation avec l'indice S&P/TSX            | <b>-0,06</b>   |
| Meilleur résultat mensuel                    | <b>11,0 %</b>  |
| Pire résultat mensuel                        | <b>-12,3 %</b> |
| Mois à rendement positif                     | <b>55,0 %</b>  |
| Rendement moyen – S&P/TSX en hausse          | <b>0,4 %</b>   |
| Rendement moyen – S&P/TSX en baisse          | <b>1,1 %</b>   |
| Baisse maximale à partir d'un sommet         | <b>21,6 %</b>  |

## Contact

Les investissements Rivemont inc.

### Gatineau

160, boul. de l'Hôpital, bureau 202  
Gatineau (Québec) J8T 8J1  
T : 819.246.8800

### Montréal

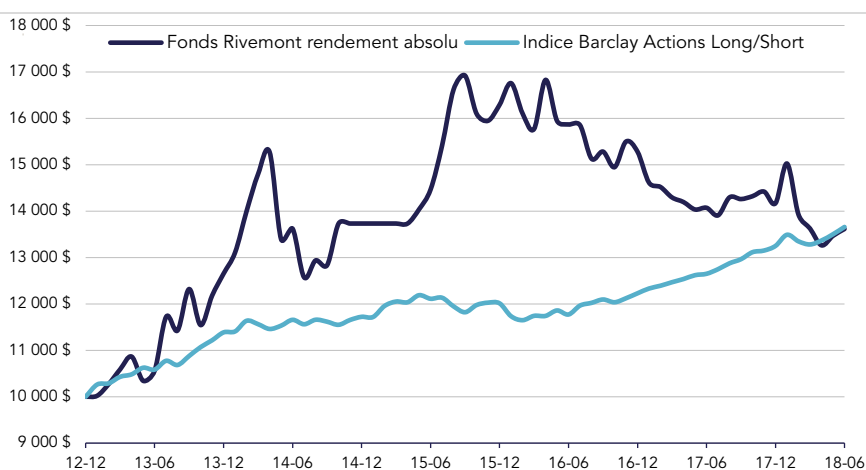
300, rue Saint-Sacrement, bureau 512  
Montréal (Québec) H2Y 1X4  
T : 438.387.3300

info@rivemont.ca  
www.rivemont.ca

## Description

Le Fonds Rivemont rendement absolu est fondé sur le constat que le prix d'un actif n'est pas toujours égal à sa valeur intrinsèque et qu'il est influencé par une multitude de facteurs, notamment les biais cognitifs des investisseurs. Puisque ces biais sont connus et qu'ils se répètent dans le temps, il est possible de prendre des décisions d'investissement basées sur ces comportements récurrents. Le fonds utilise des stratégies basées sur l'effet momentum, dont l'analyse technique et le suivi

de tendance, pour prendre des positions longues et courtes lors de cassures à la hausse et à la baisse. Le gestionnaire utilise une approche de type descendante en établissant en premier lieu les secteurs dont le potentiel à la hausse ou à la baisse est le plus important pour ensuite sélectionner les titres spécifiques parmi ces secteurs. Le fonds a comme objectif de prendre position lors du début d'une nouvelle tendance particulière et de sortir quand cette tendance est brisée.



## Rendement net de tous les frais (%)

|   |      |      |      |       |       |      |       |      |       |      |      |      | Annual / ACJ |         |
|---|------|------|------|-------|-------|------|-------|------|-------|------|------|------|--------------|---------|
|   | Jan. | Fév. | Mars | Avril | Mai   | Juin | Juil. | Août | Sept. | Oct. | Nov. | Déc. | Rivemont     | Barclay |
| <b>2013</b>   | 0.2  | 2.5  | 3.1  | 2.6   | -4.8  | 2.1  | 11.0  | -2.5 | 7.8   | -6.3 | 5.5  | 3.9  | <b>26.3</b>  | 13.9    |
| <b>2014</b>   | 3.6  | 6.8  | 5.7  | 3.2   | -12.3 | 1.7  | -7.7  | 2.9  | -0.8  | 7.0  |      |      | <b>8.6</b>   | 2.9     |
| <b>2015</b>   |      |      |      |       | 2.2   | 3.0  | 6.5   | 7.8  | 1.8   | -4.9 | -1.0 | 2.2  | <b>18.6</b>  | 2.5     |
| <b>2016</b>   | 2.9  | -3.9 | -2.1 | 6.7   | -5.2  | -0.5 | -0.1  | -4.6 | 1.0   | -2.2 | 3.7  | -1.4 | <b>-6.2</b>  | 1.8     |
| <b>2017</b>   | -4.4 | -0.6 | -1.5 | -0.7  | -1.1  | 0.3  | -1.2  | 2.8  | -0.3  | 0.4  | 0.7  | -1.7 | <b>-7.3</b>  | 8.3     |
| <b>2018</b>   | 6.0  | -7.3 | -2.2 | -2.7  | 1.5   | 1.1  |       |      |       |      |      |      | <b>-3.9</b>  | 3.1     |
| <b>Rendement annualisé net depuis la création :</b> |      |      |      |       |       |      |       |      |       |      |      |      | <b>6.4</b>   | 5.8     |

**Notes explicatives :** Les rendements sont nets de tous les frais (gestion, garde de valeurs et commissions) et en dollars canadiens. Les rendements pour la stratégie à rendement absolu proviennent d'un composé de mandats identiques pour la période de janvier 2013 à octobre 2014 et sont ceux du Fonds Rivemont rendement absolu de la série F à compter de mai 2015 (de novembre 2014 à avril 2015, les mandats en gestion distincte furent liquidés et le fonds établi). Bien que le Fonds utilise l'indice Barclay Actions Long/Short ([www.barclayhedge.com/research/indices](http://www.barclayhedge.com/research/indices)) afin de comparer la performance du Fonds à long terme, celui-ci n'est pas géré en fonction de cet indice. Les résultats futurs vont différer de ceux du passé. Les parts du Fonds sont disponibles en vertu de dispenses prévues aux exigences de prospectus, conformément au Règlement 45-106 sur les dispenses de prospectus et d'inscription, et elles ne sont donc offertes qu'aux investisseurs qualifiés. Ce document ne constitue pas une recommandation ni un conseil lié à un investissement et est présenté à titre d'information seulement.

L'administrateur est SGGG Fund Services, le vérificateur est KPMG, le conseiller juridique est Fasken Martineau et les courtiers principaux sont NBCN et Interactive Brokers Canada.

## Gestionnaire

Martin Lalonde, MBA, CFA, est le gestionnaire de portefeuille responsable des décisions de placements. Il possède plusieurs années d'expérience comme intervenant sur les marchés financiers et a œuvré, avant de fonder Rivemont, comme analyste principal aux investissements et aux fusions et acquisitions pour un important organisme canadien.

## À propos de Rivemont

Fondée en 2010, Rivemont est une firme de gestion de portefeuille québécoise avec plus de 45 millions \$ en actifs sous gestion. La firme offre des stratégies de placement performantes à une clientèle de gestion privée, de conseillers, de courtiers et de planificateurs financiers.