

Objectif de placement

La stratégie Maple a comme objectif d'offrir un rendement supérieur à l'indice composé S&P/TSX tout en ayant une volatilité plus faible des rendements.

Description

La philosophie derrière la stratégie Maple est de capturer les meilleurs rendements sectoriels de l'indice composite S&P/TSX au fil du temps. L'alpha est généré en exploitant les corrélations entre les secteurs de l'indice et en ajoutant des signaux quantitatifs pondérés de tendance. La stratégie ne sélectionne que les secteurs les plus

performants et gère dynamiquement les pondérations de chacun. La stratégie Maple ajoute un élément de gestion du risque en réduisant l'impact négatif d'une correction de marché en investissant dans une position en dollars américains lorsque la stratégie détecte un risque de baisse.

Secteurs d'activité

Biens de consommation de base	25,0 %
Consommation discrétionnaire	0,0 %
Énergie	0,0 %
Finance	0,0 %
Immobilier	0,0 %
Industriel	0,0 %
Matériaux	25,0 %
Services de télécommunication	0,0 %
Services publics	0,0 %
Métaux précieux	25,0 %
Technologies de l'information	25,0 %
Encaisse	0,0 %

Aperçu

Date de création	1 janvier 2021
Style de gestion	Momentum
Actifs de la stratégie	2 millions \$
Actifs de la firme	103 millions \$

Profil rendement/risque

Rendement net annualisé depuis la création	4,8 %
Écart-type annualisé	12,0 %
Ratio Sharpe annualisé	0,44
Corrélation avec l'indice S&P/TSX	0,71
Meilleur résultat mensuel	6,2 %
Pire résultat mensuel	-7,4 %
Mois à rendement positif	57,7 %
Rend. mensuel moyen – S&P/TSX en hausse	1,7 %
Rend. mensuel moyen – S&P/TSX en baisse	-1,7 %
Baisse maximale à partir d'un sommet	14,6 %

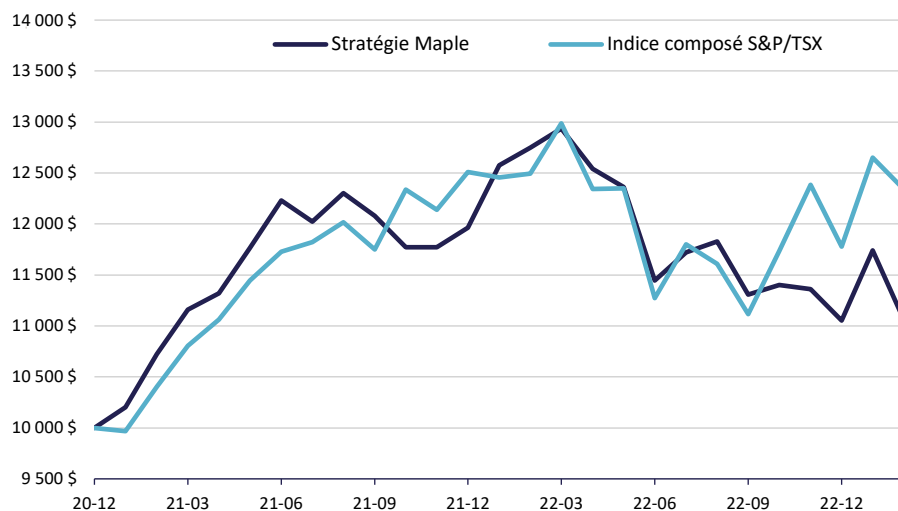
Gatineau

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

Montréal

19 rue Le Royer Ouest, suite 300
Montréal, Québec H2Y 1W4
T : 819.246.8800

info@rivemont.ca



Rendements (%)

	Annuel / AAJ												Rendement net annualisé depuis la création :	
	Jan.	Fév.	Mars	Avril	Mai	Juin	Juil.	Août	Sept.	Oct.	Nov.	Déc.	Rivemont	S&P/TSX
2021	2.0	5.1	4.1	1.4	3.9	3.9	-1.7	2.3	-1.8	-2.6	0.0	1.6	19.6	25.1
2022	5.1	1.4	1.5	-3.1	-1.4	-7.4	2.4	0.9	-4.4	0.8	-0.4	-2.7	-7.6	-5.8
2023	6.2	-5.8											0.4	4.8
													4.8	10.2

Notes explicatives : Les rendements sont nets de tous les frais (gestion, garde de valeurs et commissions) et en dollars canadiens. Les rendements sont ceux d'un composé de portefeuilles de clients ayant une stratégie similaire nommé « Maple ». Bien que la stratégie utilise l'indice composé S&P/TSX afin de comparer la performance de la stratégie à long terme, celle-ci n'est pas gérée en fonction de cet indice. Les résultats futurs vont différer de ceux du passé. Ce document ne constitue pas une recommandation ni un conseil lié à un investissement et est présenté à titre d'information seulement.

Gestionnaire

Jeffrey Veilleux 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 rejoindre Rivemont, comme gestionnaire des marchés publics et alternatifs. Il a aussi œuvré au sein de grandes banques canadiennes en marché des capitaux.

À propos de Rivemont

Fondée en 2010, Rivemont est une firme de gestion de portefeuille québécoise avec environ 100 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.