

Objectif de placement

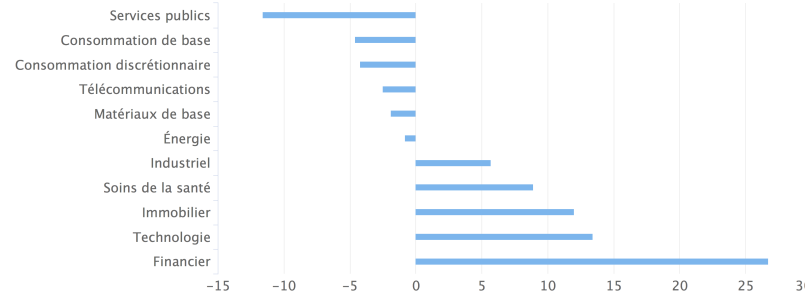
La stratégie Actions canadiennes acheteur/vendeur de Triasima consiste à effectuer des placements en positions acheteur et vendeur d'actions et de fiducies de revenu de sociétés canadiennes. L'objectif de placement est d'obtenir un rendement supérieur à l'indice constitué à 75 % du rendement des bons du Trésor à 3 mois et à 25 % de l'indice composé S&P/TSX. Il s'agit également d'atteindre deux objectifs secondaires : 1) surpasser l'indice composé S&P/TSX à long terme (quatre ans et plus) avec une volatilité moindre par rapport à l'indice et 2) obtenir un rendement positif sur des périodes mobiles de 18 mois et plus.

Stratégie de placement

Depuis 1998, l'équipe de gestion de Triasima applique sa méthodologie de recherche multidisciplinaire exclusive appelée l'Approche des trois piliers, laquelle a procuré de forts rendements sur une base relative aux clients de Triasima dans toutes les conditions du marché.

Offert sous la forme de :	Fonds commun
Date de lancement :	30 juin 2000
Méthodologie :	Trois Piliers de Triasima
Composition :	Titres de sociétés canadiennes
Nombre de titres :	Positions acheteur : de 35 à 120 Positions vendeur : de 15 à 80
Pivot :	75 % : rendement des bons du Trésor à 3 mois; 25 % : indice composé S&P/TSX

Répartition sectorielle (%)



Structure

Nombre de positions acheteur	46
Nombre de positions vendeur	35
Valeur acheteur/valeur au marché	118 %
Valeur vendeur/valeur au marché	77 %
Vendeur/acheteur	65 %
Exposition brute	195 %

Rendements bruts (%)

Rendement mensuel

Rendement annuel

AN	Jan	Fev	Mar	Avr	Mai	Juin	Juil	Août	Sept	Oct	Nov	Déc	Triasima	Indice/Index	S&P/TSX
2002	1.03	2.01	3.89	0.51	10.10	-1.32	-2.24	3.80	-0.24	-6.37	-8.37	2.61	4.2	-1.6	-12.4
2003	0.77	2.92	-1.11	-1.13	-1.74	-1.20	2.40	3.18	4.23	5.94	1.65	2.60	19.8	8.1	26.7
2004	2.80	3.81	1.04	-4.29	-0.05	2.83	1.01	0.04	0.43	0.57	5.66	3.37	18.3	4.8	14.5
2005	0.29	11.23	-2.51	-0.57	0.22	1.44	6.44	2.69	0.41	-4.93	0.91	5.82	22.5	7.2	24.1
2006	9.28	-4.66	5.76	2.99	-1.21	-2.73	-0.28	1.51	-2.60	2.83	4.59	6.14	22.8	6.6	17.3
2007	3.26	4.24	3.27	0.09	3.76	0.08	1.13	-3.16	-0.21	5.44	-3.29	1.20	16.5	5.0	9.8
2008	-7.32	4.29	1.38	2.09	4.41	14.26	-6.84	-2.84	-1.34	7.80	-2.52	-0.78	6.6	-7.2	-33.0
2009	-0.10	-4.82	-2.78	-8.46	0.47	0.60	0.33	-1.06	1.95	0.19	4.53	1.56	-7.9	7.8	35.1
2010	-5.19	2.65	4.49	1.65	-0.20	-1.77	-0.86	3.12	-3.66	0.23	2.70	0.88	3.6	3.9	17.6
2011	-0.94	4.56	0.92	0.29	1.46	-0.92	-0.92	-0.78	1.21	0.04	3.35	-1.32	7.0	-2.0	-8.7
2012	-5.07	0.05	-0.22	-0.22	-1.56	-0.26	-0.73	-1.56	-1.66	0.93	0.30	-0.38	-8.7	1.8	7.2
2013	3.66	2.79	1.06	3.96	1.08	-0.13	-0.67	-0.28	4.59	4.40	4.36	0.46	29.8	3.2	13.0
2014	-2.02	4.35	1.40	2.36	-0.64	3.35	-2.28	-0.03	-5.82	-3.00	-2.22	2.17	-2.8	2.6	10.6
2015	0.37	1.15	3.07	-3.16	1.55	0.89	8.19	-0.35	3.87	-3.74	3.23	1.73	17.5	-2.3	-8.3
2016	-1.75	-1.06	-3.86	0.42	1.23	3.25	1.53	-3.97	0.14	-2.67	-2.23	-2.53	-11.2	4.6	21.1
2017	0.36	-2.88	2.12	0.27	-1.88	-0.67	-1.10	0.49	0.48	2.16	5.67	-3.07	1.7	2.0	9.1
2018	2.61	0.33	-1.92	0.29	6.78	-0.24	-2.48	0.21	-1.85	-	-	-	3.5	0.5	1.4

Statistiques de rendement et de risque

juillet 2000 à septembre 2018

	Rendement composé annualisé (%)	Alpha annualisé (%)	Corrélation – base mensuelle (%)	Bêta	Écart-type annualisé (%)	Ratio de Sharpe annualisé	Limite de prélèvement (%)	Pire résultat mensuel (%)	Meilleur résultat mensuel (%)
Triasima	9.1	-	-	-	11.7	0.7	-21.2	-8.5	14.3
Indice/Index	2.3	9.0	9.4	0.33	3.3	0.4	-11.7	-4.1	3.0
S&P/TSX	5.0	9.4	8.2	0.07	13.2	0.3	-43.3	-16.7	11.5

Contact

Gestion de portefeuille Triasima inc.
1555, rue Peel, bureau 1200, Montréal (Québec)
H3A 3L8
514.906.0667 / clients@triasima.com

Note explicative

Les résultats de gestion sont présentés avant les frais de gestion, d'administration et de performance, et sont annualisés pour les périodes de plus d'un an. Les résultats de gestion pour la stratégie actions canadiennes acheteur/vendeur proviennent d'un composé de mandats identiques. Les résultats futurs vont différer de ceux du passé.