

Marco Lepore, Gestionnaire de portefeuille
514 282-5874 | Marco.Lepore@NBPCD.com

Benoit Gosselin, Gestionnaire de portefeuille
514 282-5899 | Benoit.Gosselin@NBPCD.com

Claude Desrochers, Gestionnaire de portefeuille
514 282-5957 | Claude.Desrochers@NBPCD.com
1 800 363-6732 | leporegosselin-desrochers.com

INFORMATION SUR LE PORTEFEUILLE

Date de création	2 novembre 1998
Type de portefeuille	Grandes capitalisations américaines
Style de gestion	Momentum des cours
Indice repère	Indice S&P 500
Nombre de titres	10
Tolérance au risque	Moyenne à élevée
Trimestres haussiers	68 (indice : 69)
Trimestres baissiers	30 (indice : 29)
Meilleur trimestre	30,9 % (indice : 20,5 %)
Pire trimestre	-22,8 % (indice : -21,9 %)
Surperformance trimestre vs Indice	54,1 % du temps (53/98 trimestres)
Valeur ajoutée moyenne vs Indice	5,0% par année depuis 24 ans (au 30 juin 2023)

RENDEMENT ANNUEL COMPOSÉ — 30 JUIN 2023

PÉRIODES	1 AN	2 ANS	3 ANS	4 ANS	5 ANS	6 ANS	7 ANS	8 ANS	9 ANS	10 ANS	15 ANS	20 ANS	24 ANS
Momentum S&P 100 (\$US) (%)	25,8	12,4	22,2	22,3	19,4	21,7	20,7	18,5	17,3	17,8	12,6	13,2	12,0
Indice S&P 500 (\$US) (%) ¹	19,6	3,3	14,6	12,7	12,3	12,6	13,4	12,1	11,6	12,8	10,9	10,0	7,0

RENDEMENT ANNUEL

ANNÉES	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014	2013	2012	2011	2010	2009	2008	2007	2006	2005	2004	2003	2002	2001	2000	1999 ²
Momentum S&P 100 (\$US) (%)	16,4	-2,0	29,3	40,4	23,7	1,4	33,8	3,8	12,3	7,8	30,4	27,0	-3,0	18,6	14,2	-40,4	3,6	21,7	16,3	22,6	48,5	-10,8	-14,4	3,5	40,0
Indice S&P 500 (\$US) (%) ¹	16,9	-18,2	28,7	18,4	31,5	-4,4	21,8	11,9	1,4	13,6	32,3	15,8	2,1	15,0	26,4	-36,9	5,5	15,8	4,9	10,8	28,6	-22,0	-11,8	-9,1	21,0

(1) Source : Bloomberg, dividendes réinvestis trimestriellement.

(2) Date de création : 2 novembre 1998. Le portefeuille a fait 9,9% vs 10,9% pour l'indice du 2 novembre 1998 au 31 décembre 1998.

Tous les rendements présentés tiennent compte des dividendes. Les rendements du portefeuille modèle sont calculés avant les honoraires. Les rendements passés ne sont pas garants des rendements futurs.

BMO Nesbitt Burns Inc. est membre du Fonds canadien de protection des épargnants. Membre de l'Organisme canadien de réglementation du commerce des valeurs mobilières. © Lepore-Gosselin-Desrochers Gestion de patrimoine — Avis légal

MOMENTUM S&P 100 | Portefeuille modèle — 30 juin 2023

PHILOSOPHIE D'INVESTISSEMENT

Le portefeuille Momentum S&P 100, géré par l'équipe Lepore-Gosselin-Desrochers, a pour objectif de générer des rendements supérieurs au marché boursier américain. Nous sélectionnons les titres parmi les cent plus grandes sociétés aux États-Unis en utilisant un algorithme mathématique basé sur la performance antérieure des actions. Tous les trimestres, les actions ne répondant plus aux critères *momentum* sont remplacées, permettant ainsi au portefeuille de s'adapter rapidement aux marchés changeants. Cette approche exclut l'émotion humaine qui pourrait nuire au rendement et à la constitution d'un portefeuille de qualité supérieure.

Momentum S&P 100 vs Indice S&P 500

