

**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 canadiennes
Style de gestion	Momentum des cours
Indice repère	Indice composé S&P/TSX
Nombre de titres	10
Tolérance au risque	Moyenne à élevée
Trimestres haussiers	65 (indice : 67)
Trimestres baissiers	33 (indice : 31)
Meilleur trimestre	71,8 % (indice : 21,4 %)
Pire trimestre	-31,1 % (indice : -22,7 %)
Surperformance trimestre vs Indice	57,1 % du temps (56/98 trimestres)
Valeur ajoutée moyenne vs Indice	6,1 % 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 TSE 100 (\$CDN) (%)	7,3	5,1	20,2	14,0	10,7	12,4	8,3	9,5	10,0	11,6	6,4	13,1	13,3
Indice composé S&P/TSX (%) <sup>1</sup>	10,6	3,1	12,5	8,6	7,7	8,1	8,5	7,4	6,4	8,4	5,4	8,4	7,2

## RENDEMENT ANNUEL

ANNÉES	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014	2013	2012	2011 <sup>3</sup>	2010 <sup>3</sup>	2009 <sup>3</sup>	2008 <sup>3</sup>	2007 <sup>3</sup>	2006	2005	2004	2003	2002	2001	2000	1999 <sup>2</sup>
Momentum TSE 100 (\$CDN) (%)	0,1	-0,2	38,9	22,7	18,7	-10,5	4,0	9,6	7,1	22,5	16,5	-5,7	-17,6	37,5	38,9	-36,6	32,0	11,6	47,4	41,9	27,2	-1,0	-3,7	-0,7	84,4
Indice composé S&P/TSX (%) <sup>1</sup>	5,8	-5,8	25,2	5,6	22,8	-8,9	9,1	21,0	-8,3	10,5	13,0	7,1	-8,7	17,6	34,9	-32,9	9,8	17,3	24,3	14,4	26,7	-12,4	-12,5	7,4	31,7

(1) Indice TSE 300 jusqu'au 30 avril 2002, Indice S&P/TSX par la suite. Source : Bloomberg, dividendes réinvestis trimestriellement.

(2) Date de création : 2 novembre 1998. Le portefeuille a fait 5,9 % vs 3,0 % pour l'indice du 2 novembre 1998 au 31 décembre 1998.

(3) Le calcul du rendement annuel a été vérifié par la firme comptable Raymond Chabot Grant Thornton.

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 TSE 100 | Portfeuille modèle — 30 juin 2023

## PHILOSOPHIE D'INVESTISSEMENT

Le portefeuille Momentum TSE 100, géré par l'équipe Lepore-Gosselin-Desrochers, a pour objectif de générer des rendements supérieurs au marché boursier canadien. Nous sélectionnons les titres parmi les cent-vingt plus grandes sociétés au Canada 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 TSE 100 vs Indice composé S&P/TSX

