



Actions Canadiennes à Faible Volatilité

Sommaire

Cette stratégie quantitative vise à réaliser un rendement supérieur à l'indice MSCI Canada IMI à moyen et long terme, avec une volatilité inférieure et un revenu courant intéressant.

Style	Quantitatif
Processus	Fondamental ascendant
Horizon	Moyen à long terme
Indice de référence	MSCI Canada IMI
Objectif de valeur ajoutée	0,9 % sur cycle de marché (avant frais de gestion)
Capitalisation boursière	Plus de 500 M\$
Taux de rotation	40 % en moyenne

Pourquoi investir

- Approche axée sur les secteurs les plus défensifs pour une meilleure préservation du capital
- Processus d'investissement discipliné qui combine l'utilisation de filtres quantitatifs et l'analyse fondamentale effectuée par des gestionnaires
- Potentiel de rendement annualisé supérieur à l'indice de référence
- Génère régulièrement une volatilité inférieure à celle de l'indice
- Taux de dividende supérieur à l'indice
- Équipe de gestion stable et expérimentée

Philosophie d'investissement

Plusieurs études empiriques démontrent qu'il est possible de construire un portefeuille d'actions en minimisant le risque sans pour autant en réduire le rendement. Selon la théorie moderne du portefeuille, il s'agit d'une anomalie de marché. La stratégie Optimum Actions Canadiennes à Faible Volatilité a pour objectif d'exploiter cette anomalie de marché en utilisant une approche ascendante de sélection de titres de l'indice MSCI Canada IMI. L'intégration des facteurs environnementaux, sociaux et de gouvernance (ESG) est prise en compte dans le processus d'investissement. La stratégie se démarque principalement en période de marchés baissiers.

Processus d'investissement

ANALYSE



CONSTRUCTION DU PORTEFEUILLE

L'univers des titres autorisés est celui de l'indice MSCI Canada IMI. Les contraintes suivantes sont appliquées pour la sélection de titres :

- Capitalisation boursière > 500 millions \$
- Titres avec dividendes
- Limite sectorielle
- Bêta inférieur au marché
- Surpondération des secteurs défensifs

Équipe de gestion



Martin Delage
CFA, M.Sc.
Chef des placements
canadiens
30 ans d'expérience



Nicolas Poirier
CFA, M.Sc.
Directeur,
Revenu variable
9 ans d'expérience