OPTIMUM
Gestion mondiale d'actifs

Fiche technique
Au 30 septembre 2026

Actions canadiennes multifacteurs

Objectifs de placement

La stratégie Optimum Actions canadiennes multifacteurs a pour objectif l'appréciation du capital sur un horizon de moyen à long terme et de générer un rendement annuel moyen équivalent à l'indice de référence, **majoré de 1,00 %** sur des périodes mobiles de quatre ans (avant frais de gestion).

Le portefeuille est composé principalement d'actions ordinaires émises par des sociétés canadiennes. Cette Stratégie regroupe trois composantes à pondération égale afin d'optimiser la relation risque-rendement du portefeuille et de maximiser la probabilité d'atteindre l'objectif de valeur ajoutée. Ces trois composantes sont : la composante à faible volatilité, la composante équipondérée et la composante momentum.

Date de création	Juin 2014
Véhicule offert	Titres ségrégués
Actifs sous gestion	88,75 M$
Indice de référence	MSCI Canada IMI
Distribution de revenu	Trimestrielle

Pourquoi investir?

- Gestion systématique performante
- Approche réduisant les risques liés au marché boursier canadien
- Taux d'efficacité élevé dans tous les environnements de marché (haussiers et baissiers)
- Processus rigoureux et discipliné ayant recours à des critères d'investissement purement quantitatifs
- Équipe de gestion stable et expérimentée

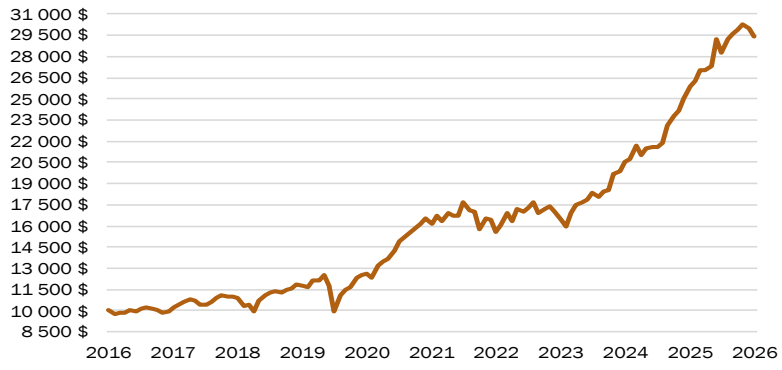
Niveau de risque

Faible	Faible à moyen	Moyen	Moyen à élevé	Élevé

Optimum Gestion de Placements estime que la volatilité de la stratégie Actions canadiennes multifacteurs est moyenne.

Ce niveau est établi d'après la variation de rendements d'une année à l'autre. Il n'indique pas la volatilité future et peut changer avec le temps. Un niveau de risque faible peut voir sa valeur diminuer.

Croissance de 10 000 $ depuis septembre 2016



- **Meilleur trimestre**
  2e trimestre 2020 : 17,03 %
- **Pire trimestre**
  1er trimestre 2020 : -18,46 %

Optimum Gestion mondiale d'actifs est un nom commercial du Groupe Optimum inc. utilisé sous licence.

PRI Principles for Responsible Investment

OPTIMUM
Gestion mondiale d'actifs

Fiche technique

Au 30 septembre 2026

Actions canadiennes multifacteurs

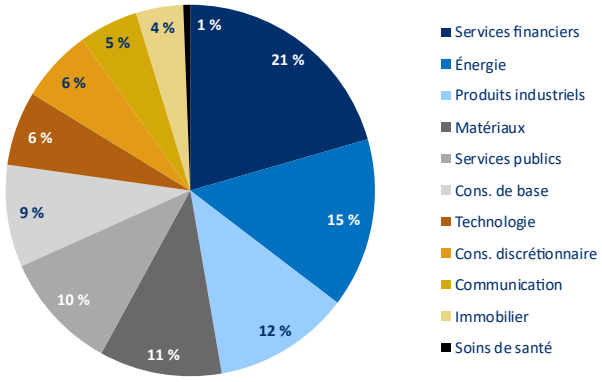
Performance de la stratégie

Rendements annualisés (%)	1 an	2 ans	3 ans	4 ans	5 ans	10 ans	Depuis création*
Portefeuille	13,49	19,51	21,39	17,09	12,58	11,33	10,10
MSCI Canada IMI	21,73	26,00	26,35	22,25	16,07	12,72	10,50
Valeur ajoutée	-8,25	-6,49	-4,96	-5,16	-3,50	-1,39	-0,40

Rendements par période (%)	3 mois	AACJ	2025	2024	2023	2022	2021	2020
Portefeuille	-1,76	8,65	28,76	19,70	7,11	-3,56	25,36	10,68
MSCI Canada IMI	2,52	14,15	33,10	22,93	12,29	-5,74	25,36	5,87
Valeur ajoutée	-4,28	-5,50	-4,33	-3,23	-5,19	2,18	0	4,82

* Date de création : Juin 2014, La performance est présentée en dollars canadiens, avant les frais de gestion, et est annualisée pour toutes les périodes de plus d'un an, Cette information est présentée uniquement à titre informatif, Veuillez lire la note légale présentée à la fin de ce document.

Répartition sectorielle



Dix principaux titres du portefeuille

	%
CENOVUS ENERGY INC.	2,32
CANADIAN NATURAL RESOURCES LIMITED	2,20
IMPERIAL OIL LIMITED	2,15
MANULIFE FINCL CORP.	2,09
SAPUTO INC.	2,08
DOLLARAMA INC.	2,07
FORTIS INC.	2,07
BANQUE TORONTO-DOMINION	2,06
LOBLAW COS LTD.	2,06
GEORGE WESTON LTD.	2,04

Analyse risque-rendement

	Portefeuille	Indice
Écart-type	11,38 %	12,72 %
Bêta	0,83	1,00
Ratio Sharpe	0,74	0,69
Erreur de calquage	4,70 %	-
Ratio d'information	-0,08	-
Participation aux marchés haussiers	86 %	-
Participation aux marchés baissiers	83 %	-
Moyenne au bâton haussier	41 %	-
Moyenne au bâton baissier	72 %	-

Caractéristiques

	Portefeuille
Cap. boursière médiane (G$)	57,86
Nombre de titres	105
RCP – Moyenne 5 ans	13,63 %
Cours/bénéfice	15,93
Croissance des revenus – 5 ans	10,20 %
Taux de dividende	2,56 %
Dette nette/BAIIA	2.61
Empreinte carbone (intensité, Mt)	232,08

OPTIMUM
Gestion mondiale d'actifs

Fiche technique

Qui nous sommes

Optimum Gestion de Placements est une firme de gestion d'actifs qui dessert une clientèle institutionnelle et privée. La firme est détenue par Optimum Groupe financier, un groupe privé canadien d'envergure internationale, qui compte plus de 700 employés à travers le Canada, les États-Unis et la France.

Notre créativité et notre compréhension des marchés, nous permettent d'élaborer des stratégies diversifiées qui s'appuient sur des éléments fiables de recherche quantitative, de recherche fondamentale et sur des outils technologiques modernes. Nos services de gestion reposent sur une longue expérience qui assure leur qualité constante. Notre approche de type « CAPR » (croissance à prix raisonnable) nous permet d'offrir des stratégies d'investissement sophistiquées tout en mettant l'accent sur la préservation du capital et la gestion des risques.

Contact

info@optimumgam.ca

optimumgam,ca

514 288-7545

425, boul, De Maisonneuve Ouest
bureau 1620
Montréal (Québec) H3A 3G5

Note légale

La performance de cette stratégie provient d'un composé de mandats regroupant le rendement de plusieurs portefeuilles de clients ayant des mandats et des stratégies de placement similaires. La performance est présentée en dollars canadiens avant les frais de gestion et est annualisée pour toutes les périodes de plus d'un an.

Les informations contenues dans le présent document sont fournies à titre informatif uniquement et ne devraient pas être considérées comme des conseils en placement s'appliquant à votre situation financière ni comme des conseils précis de nature financière, légale, comptable, fiscale ou en matière de placements. Nous n'assumons aucune responsabilité pour toute perte subie en raison de l'utilisation de ces données. Ces dernières ne doivent pas être considérées comme une sollicitation d'achat ni une offre de vente d'un titre. Elles ne tiennent pas compte des objectifs de placement, de la situation fiscale ni de l'horizon de placement précis d'un investisseur. Il n'existe aucune représentation, garantie ni même responsabilité quant à l'exactitude des décisions fondées sur ces données. Toutes les données sur le rendement tiennent compte du réinvestissement des distributions ou des dividendes et ne tiennent pas compte des frais de gestion et autres frais que doit payer l'investisseur et qui ont pour effet de réduire les rendements.

L'indice utilisé dans le présent document est un indice généralement reconnu pour mesurer le rendement des placements dans cette catégorie d'actifs et a été choisi en raison de son degré de comparabilité et de similarité avec la stratégie de placement présentée.

Le présent document contient des informations (les « Informations ») provenant de MSCI Inc., de ses sociétés affiliées ou de ses fournisseurs d'informations (collectivement, « MSCI ») et peuvent avoir été utilisées pour calculer des scores, des notations ou d'autres indicateurs. Les informations sont destinées à un usage interne uniquement et ne peuvent être

OPTIMUM®
Gestion mondiale d'actifs

Fiche technique

Note légale (suite)

reproduites/rediffusées sous quelque forme que ce soit, ou utilisées comme base ou composant de tout instrument financier, produit ou indice. MSCI ne garantit pas l'originalité, l'exactitude et/ou l'exhaustivité des données ou informations contenues dans le présent document et décline expressément toute garantie expresse ou implicite, y compris de qualité marchande et d'adéquation à un usage particulier. Les Informations ne sont pas destinées à constituer un conseil d'investissement ou une recommandation de prendre (ou de s'abstenir de prendre) une décision d'investissement et ne peuvent être considérées comme telles, ni ne doivent être considérées comme une indication ou une garantie de toute performance future, analyse, prévision ou prédiction. MSCI n'assume aucune responsabilité pour toute erreur ou omission en relation avec les données ou informations contenues dans le présent document, ni aucune responsabilité pour tout dommage direct, indirect, spécial, punitif, consécutif ou tout autre dommage (y compris la perte de profits), même si elle est informée de la possibilité de tels dommages.

Optimum Gestion de Placements inc. ne peut garantir les rendements futurs des stratégies. La valeur fluctue fréquemment et les rendements passés ne sont pas indicatifs des rendements futurs.

OPTIMUM®
® Marque de commerce de Groupe Optimum inc. utilisée sous licence.

PRI Principles for Responsible Investment