

L'indice NASDAQ d'Inovestor Canada recherche des actions qui génèrent un haut niveau de **profit économique**. L'Indice est composé d'un portefeuille équilibré d'actions de 25 grandes sociétés canadiennes inscrites à la bourse. Il est conçu pour procurer une exposition à des titres de sociétés de qualité se transigeant à un prix raisonnable grâce au modèle de sélection de titres d'Inovestor.

**Critères de Sélection** – Les 25 meilleures actions canadiennes par pointage StockPointer

- Pointage SP : 50 % évaluation du rendement et 50 % évaluation des risques
- Les 25 sociétés ayant enregistré les meilleurs pointages dans SP font partie du portefeuille
- Titres rééquilibrés tous les trimestres

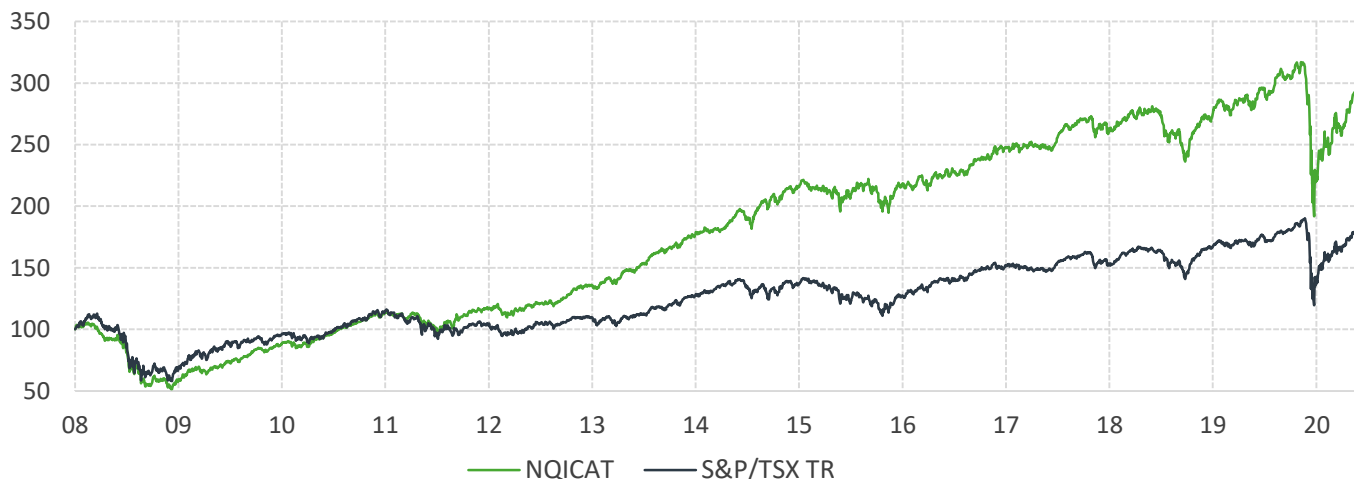
## Critères de sélection

Facteurs de performance	Facteurs de risque
Indice de performance	Prix / Valeur Intrinsèque
Flux d'argent libre / Capital	Prix / Valeur Intrinsèque Moyenne
Croissance du profit économique	Valeur de la croissance future
Stabilité de l'entreprise	Stabilité de l'entreprise
Croissance du dividende à long terme	Levier financier
Croissance du BPA à long terme	Revenus

## Caractéristiques clés

Depuis sa création	NQICAT	S&P/TSX TR
Rendement Annualisé (%)	8.9	4.8
Écart type (%)	14.5	13.9
« maximum drawdown » (%)	-51.3	-48.5
Ratio Sharpe	0.6	0.3
Ratio Sortino	0.7	0.4
Corrélation de l'indice	0.9	1.0
R au carré	0.8	1.0
Bêta	0.9	1.0
Alpha (%) (Annualisé)	4.2	0.0

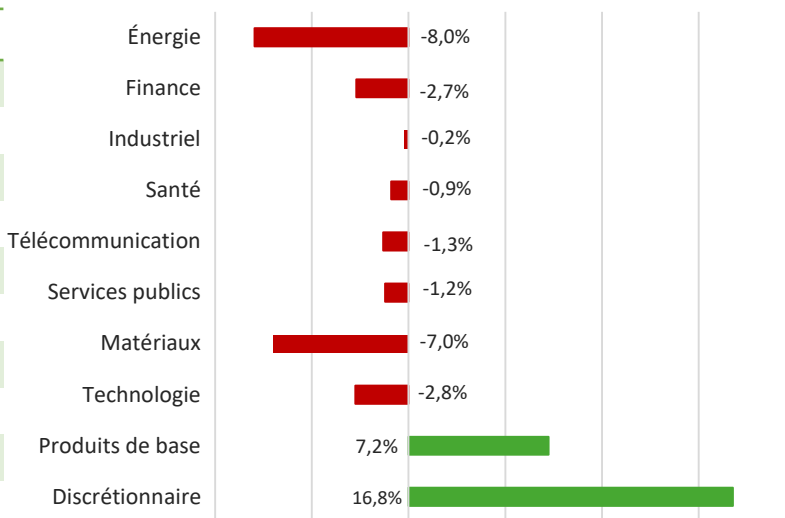
## Performance depuis la création 31/08/2020



## 10 principaux titres

Nom du titre 31/08/2020	Poids
Kirkland Lake Gold	4.42%
Banque Nationale du Canada	4.39%
First National Financial Corp	4.34%
Canadian Tire	4.33%
Equitable Group	4.29%
Great-West Lifeco Inc.	4.23%
TFI International	4.12%
Canadian National Railways	4.09%
Richelieu Hardware Ltd.	4.08%
Kirkland Lake Gold	4.07%

## Déviations sectorielles (vs. S&P/TSX) 31/08/2020



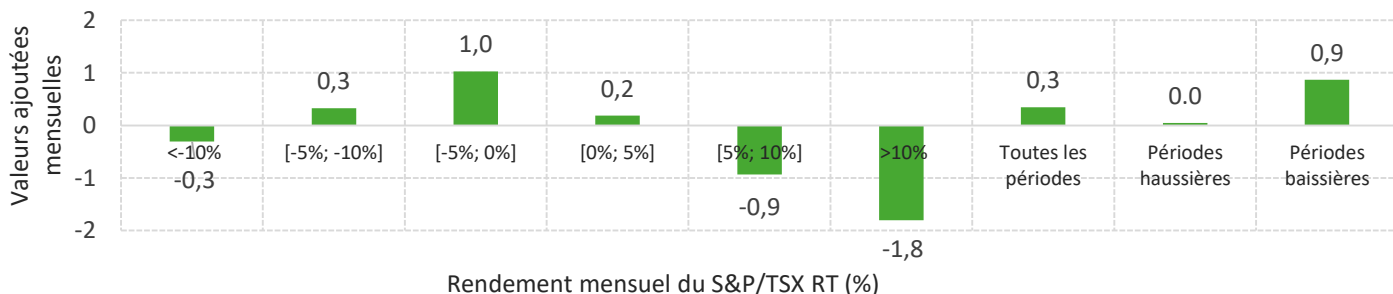
## Rendement Annuel

31/08/2020	ACJ	1M	3M	6M	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Création
NQICAT	-4.7	1.9	9.9	2.2	0.6	5.1	6.9	11.8	8.9
S&P/TSX RT	-1.1	2.3	9.6	3.4	3.8	6.0	6.8	6.4	4.8
Différence	-3.7	-0.5	0.3	-1.1	-3.2	-0.9	0.1	5.4	4.2

## Rendement calendrier

31/08/2020	2009	2010	2011	2012	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	ACJ
NQICAT	40.6	26.4	4.2	14.4	32.3	25.4	1.2	11.9	14.2	-9.8	24.1	-4.7
S&P/TSX RT	35.1	17.6	-8.7	7.2	13.0	10.6	-8.3	21.1	9.1	-8.9	22.9	-1.1
Différence	5.5	8.8	12.9	7.2	19.3	14.8	9.5	-9.1	5.1	-0.9	1.3	-3.7

## Valeur Ajoutée 31/08/2020



Fondée en 1999, **Inovestor** est l'un des principaux fournisseurs de plateformes et de services financiers numériques professionnels telles que les plateformes logicielles StockGuide et StockPointer. Les principaux conseillers en investissement canadiens, les banques, les compagnies d'assurance et les bourses se sont appuyés sur les données fondamentales et les analyses d'Inovestor pour prendre des décisions d'investissement optimales. Inovestor a des bureaux à Montréal et Toronto au Canada ainsi qu'à Greenwich aux États-Unis.

À TITRE INFORMATIF SEULEMENT. L'information contenue dans ce rapport a été obtenue de plusieurs sources; nous ne pouvons donc garantir qu'elle soit complète ni exacte. Ce document est publié à titre informatif seulement et ne devrait pas être interprété comme une sollicitation ou même une recommandation pour acheter ou vendre quelque valeur que ce soit. StockPointer inc., ses dirigeants, employés ou sociétés affiliées peuvent détenir une position dans l'une ou l'autre des sociétés mentionnées dans ce rapport.