

PORTEFEUILLE DIVERSIFIÉ EXEMPLAR

Information trimestrielle sur le Portefeuille - Au 31 mars 2018

Pondération par secteur	Exposition à long terme [‡] (%)	Exposition à court terme [‡] (%)	25 principaux titres en portefeuille [‡]	%
Contrats à terme standardisés sur obligations	-	(86,0)	Positions acheteur	
Contrats à terme standardisés sur marchandises	52,1	(61,7)	Trésorerie et équivalents de trésorerie	99,0
Contrats à terme standardisés sur taux d'intérêt	9,5	(407,8)	EURO/CHF Futures (CME)	32,5
Contrats à terme standardisés sur monnaies	102,5	(16,3)	BP Currency Futures (CME)	21,3
Contrats à terme standardisés sur indices	4,7	(12,1)	EURO FX Currency Futures (CME)	13,7
Options	0,5	-	Mexican Peso Futures (CME)	13,4
Trésorerie et équivalents de trésorerie	99,0	-	Gold 100 oz Futures (CMX)	12,8
Autres actifs (passifs)	-	-	Japanese Yen Currency Futures (CME)	11,4
	268,3	(583,9)	3 Month Euro Euribor Futures (ICF)	9,5
			Gas Oil Futures (ICE)	9,0
			Brent Crude Futures (ICE)	8,5
			WTI Crude Futures (NYM)	8,0
			Gasoline Rbob Futures (NYM)	5,6
			Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	244,7
			Positions vendeur	
			90 Day Sterling Futures (ICF)	(202,7)
			90 Day Australian Bank Bill Futures	(104,5)
			90 Day EuroDollar Futures (CME)	(100,6)
			Japan 10 Year Mini Bond Futures (SGX)	(39,3)
			Euro-Bund Futures (EUX)	(12,8)
			US 5 Year Treasury Notes Futures (CBT)	(10,1)
			Bank Acceptance Futures (MSE)	(9,5)
			US 10 Year Note Futures (CBT)	(7,9)
			PRI Aluminum Futures (LME)	(7,4)
			Sugar # 11 World Futures (NYB)	(6,4)
			Dax Index Futures (EUX)	(5,7)
			Lean Hogs Futures (CME)	(5,7)
			Soybean Oil Futures (CBT)	(5,4)
			Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	(518,0)
			Total (%)	(273,3)
			Total de la valeur liquidative (en millions \$)	33,5

Les placements et les pourcentages peuvent changer en raison des transactions suite à la gestion continue du portefeuille.

Les mises à jour trimestrielles sont disponibles sur le site www.arrow-capital.com 60 jours suivant la fin du trimestre, sauf pour le trimestre se terminant le 31 décembre où elles sont disponibles dans les 90 jours.

[‡] Positions à terme standardisées sont calculées en utilisant les valeurs théoriques.