

PORTEFEUILLE DIVERSIFIÉ EXEMPLAR

Information trimestrielle sur le Portefeuille - Au 31 mars 2017

Pondération par secteur	Exposition à long terme [†] (%)	Exposition à court terme [†] (%)	25 principaux titres en portefeuille [†]	%
Contrats à terme standardisés sur obligations	14,9	-146,5	Positions acheteur	
Contrats à terme standardisés sur marchandises	26,3	-66,6	90DAY EURODOLLAR FUTURE (CME)	192,1
Contrats à terme standardisés sur taux d'intérêt	396,7	-	90DAY BANK ACCEPT FUTURE (MSE)	177,5
Contrats à terme standardisés sur monnaies	61,5	-17,7	Trésorerie et équivalents de trésorerie	71,7
Contrats à terme standardisés sur indices	60,7	-	LONG GILT FUTURE (ICF)	14,9
Options	0,3	-	S & P 500 EMINI INDEX FUT(CME)	12,7
Trésorerie et équivalents de trésorerie	71,7	-	NASDAQ 100 E-MINI INDEX FUTURE	11,7
Autres actifs (passifs)	-	-0,1	LIVE CATTLE FUTURE (CME)	11,6
	632,1	-230,9	BRAZIL REAL FUTURE (CME)	11,5
			JAPANESE YEN CCY FUTURE (CME)	11,3
			SPI 200 INDEX FUTURE (SFE)	10,4
			EURO/GBP FUTURE (CME)	10,0
			AUSTRALIAN DOLLAR CCY FUT(CME)	9,7
			MEXICAN PESO FUTURE (CME)	9,5
			90DAY STERLING FUTURE (ICF)	9,3
			3MO EURO EURIBOR FUTURE (ICF)	9,0
			90 DAY AUS BK BILL FUT (SFE)	8,8
			DAX INDEX FUTURE (EUX)	8,6
			HANG SENG IND FUT (HKG)	8,1
			Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	598,4
			Positions vendeur	
			EURO-BOBL FUTURES	-81,2
			US 5YR TREAS NTS FUTURE (CBT)	-14,0
			JAPAN 10YR MINI BD FUTURE(SGX)	-13,6
			EURO-BUND FUTURE (EUX)	-12,8
			C\$ CURRENCY FUTURE (CME)	-11,2
			AUSTRALIAN 10YR BOND FUT (SFE)	-9,1
			CANADA 10YR BOND FUTURE (MSE)	-7,7
			Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	(149,6)
			Total (%)	448,8
			Total de la valeur liquidative (en millions \$)	35,7

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.