

# PORTEFEUILLE DIVERSIFIÉ EXEMPLAR

Information trimestrielle sur le Portefeuille - Au 30 septembre 2017

Pondération par secteur	Exposition à long terme <sup>†</sup> (%)	Exposition à court terme <sup>†</sup> (%)	25 principaux titres en portefeuille <sup>†</sup>	%
Contrats à terme standardisés sur obligations	22,1	(226,5)	<b>Positions acheteur</b>	
Contrats à terme standardisés sur marchandises	61,2	(38,9)	Trésorerie et équivalents de trésorerie	99,8
Contrats à terme standardisés sur taux d'intérêt	40,6	(402,1)	EURO/CHF FUTURE (CME)	26,2
Contrats à terme standardisés sur monnaies	118,6	(6,9)	90 DAY AUS BK BILL FUT (SFE)	25,7
Contrats à terme standardisés sur indices	71,7	-	EURO/JPY FUTURE (CME)	22,8
Options	0,3	-	CANADIAN DOLLAR FUTURES (CME)	19,5
Trésorerie et équivalents de trésorerie	99,8	-	S & P 500 EMINI INDEX FUT (CME)	18,5
Autres actifs (passifs)	-	(0,1)	DAX INDEX FUTURE (EUX)	11,7
	<b>414,3</b>	<b>(674,5)</b>	BRITISH POUND CURRENCY FUTURE	11,7
			S&P/TSE 60 INDEX FUTURES MSE	11,4
			NASDAQ 100 E-MIN IND FUT(CME)	11,1
			HANG SENG INDEX FUTURE (HKG)	10,9
			AUSTRALIAN DOLLAR CCY FUT(CME)	9,7
			NY HARB ULSD FUTURE (NYM)	9,4
			GAS OIL FUTURE (ICE)	9,2
			3MO EURO EURIBOR FUTURE (ICF)	9,2
			EURO/GBP FUTURE (CME)	9,1
			ZINC FUTURE (LME)	7,3
			US 5 YEAR NOTE FUTURE (CBT)	7,3
			<b>Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale</b>	<b>330,5</b>
			<b>Positions vendeur</b>	
			90DAY STERLING FUTURE (ICF)	(219,4)
			90DAY BANK ACCEPT FUTURE (MSE)	(182,7)
			EURO-BOBL FUTURE (EUX)	(62,9)
			JAPAN 10YR MINI BD FUTURE(SGX)	(62,5)
			EURO-BUND FUTURE (EUX)	(44,8)
			CANADA 10YR BOND FUTURE (MSE)	(44,0)
			AUSTRALIAN 10YR BOND FUT (SFE)	(12,3)
			<b>Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale</b>	<b>(628,6)</b>
			<b>Total (%)</b>	<b>(298,1)</b>
			<b>Total de la valeur liquidative (en millions \$)</b>	<b>32,3</b>

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](http://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.

<sup>†</sup> Positions à terme standardisées sont calculées en utilisant les valeurs théoriques.