

# PORTEFEUILLE DIVERSIFIÉ EXEMPLAR

Information trimestrielle sur le Portefeuille - Au 30 septembre 2018

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	1,3	-	<b>Positions acheteur</b>	
Contrats à terme standardisés sur marchandises	3,1	(0,9)	3 Month Euro Euribor Futures (ICF)	121,0
Contrats à terme standardisés sur taux d'intérêt	-	-	Trésorerie et équivalents de trésorerie	95,4
Contrats à terme standardisés sur monnaies	0,5	(0,2)	90 Day Bank Bill Future (SFE)	59,8
Contrats à terme standardisés sur indices	0,8	-	90 Day Sterling Future (ICF)	37,9
Options	0,1	-	S&P 500 EMini Index Future(CME)	22,7
Trésorerie et équivalents de trésorerie	95,4	-	Nikkei 225 Future (SGX)	14,2
Autres actifs (passifs)	-	(0,1)	Nasdaq 100 E-Mini Future (CME)	12,7
	<b>101,2</b>	<b>(1,2)</b>	Low Sugar Gas Oil G Future (ICE)	12,3
			Mexican Peso Future (CME)	9,9
			Brent Crude Future (ICE)	9,9
			Bank Acceptance Future (MSE)	9,6
			Wti Crude Future (NYM)	9,0
			EURO/GBP Future (CME)	8,9
			Gasoline RBOB Future (NYM)	7,3
			NY Harb ULSD Future (NYM)	6,8
			<b>Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale</b>	<b>437,4</b>
			<b>Positions vendeur</b>	
			EURO-BOBL Future (EUX)	(92,7)
			US 5 year Note Future (CBT)	(63,4)
			Japan 10 Year Mini Bond Future(SGX)	(57,8)
			US 10 Year Note Future (CBT)	(42,5)
			Euro-Bund Future (EUX)	(36,0)
			Canada 10 Year Bond Future (MSE)	(31,6)
			US Long Bond Future (CBT)	(21,8)
			JPN YEN Currency Future (CME)	(17,6)
			Palm Oil Future (MDV)	(8,7)
			Cotton No. 2 Future (NYB)	(6,8)
			<b>Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale</b>	<b>(378,9)</b>
			<b>Total (%)</b>	<b>58,5</b>
			<b>Total de la valeur liquidative (en millions \$)</b>	<b>35,7</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 théorique.