

PORTEFEUILLE DIVERSIFIÉ EXEMPLAR

Information trimestrielle sur le Portefeuille - Au 31 mars 2019

Pondération par secteur	Exposition		25 principaux titres en portefeuille [†]	%
	à long terme [‡] (%)	à court terme [‡] (%)		
Contrats à terme standardisés sur obligations	0,9	(0,6)	Positions acheteur	
Contrats à terme standardisés sur marchandises	2,4	(1,0)	Contrats à terme normalisés sur taux Euribor de 3 mois	186,1
Contrats à terme standardisés sur taux d'intérêt	0,2	(0,1)	Contrats à terme normalisés sur les acceptations bancaires de 90 jours	138,6
Contrats à terme standardisés sur monnaies	0,8	(0,5)	Contrats à terme normalisés sur l'euro de 90 jours	131,4
Contrats à terme standardisés sur indices	1,1	(0,1)	Contrats à terme normalisés sur les acceptations bancaires	107,8
Options	0,1	-	Espèces et quasi-espèces	98,2
Espèces et quasi-espèces	98,2	-	Contrats à terme normalisés sur la livre sterling à 90 jours	81,1
Autres actifs (passifs)	-	(1,4)	Contrats à terme normalisés sur obligations de 5 ans du Trésor des États-Unis	52,5
	103,7	(3,7)	Contrats à terme sur obligations canadiennes à 10 ans	44,7
			Contrats à terme normalisés sur gilts position acheteur	35,1
			Contrats à terme normalisés sur obligations de 10 ans du Trésor des États-Unis	35,0
			Contrats à terme normalisés sur obligations de 10 ans de l'Australie	35,0
			Contrats à terme normalisés sur obligations du Trésor américain	18,3
			Contrats à terme normalisés sur le peso mexicain	9,3
			Contrats à terme normalisés sur le bétail vivant	7,6
			Contrats à terme normalisés E-mini sur l'indice S&P 500	7,0
			Contrats à terme normalisés sur le gaz et le pétrole	6,8
			Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	994,5
			Positions vendeur	
			Contrats à terme normalisés mini sur obligations à 10 ans du Japon	(39,0)
			Contrats à terme normalisés EURO-BOBL	(27,4)
			Contrats à terme normalisés EURO/CHF	(12,0)
			Contrats à terme normalisés sur le dollar canadien	(12,0)
			Contrats à terme normalisés sur l'euro FX	(10,4)
			Contrats à terme normalisés sur le canola	(10,2)
			Contrats à terme normalisés EURO-BUND	(9,1)
			Contrats à terme normalisés sur le pétrole brut	(8,2)
			Contrats à terme normalisés EURO/GBP	(6,9)
			Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	(135,2)
			Total (%)	859,3
			Total de la valeur liquidative (en millions \$)	10,9

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 théorique.