

# Portefeuilles Exemplar diversifié (A)

L'objectif de placement du Portefeuille diversifié Exemplar consiste à rechercher des rendements absolus supérieurs à long terme non corrélés qui soient indépendants des fluctuations des marchés boursiers et obligataires. Le portefeuille est établi selon un processus quantitatif qui génère des positions acheteur et vendeur en options et en contrats à terme ainsi qu'en autres instruments financiers dérivés sur matières premières, métaux, énergie, devises, taux d'intérêt, et indices boursiers.

## Gestionnaire de portefeuille

Roland Austrup

M. Austrup compte plus de 25 années d'expérience dans le secteur des placements à des postes de chef de la direction, chef des placements et administrateur pour le compte d'Integrated Managed Futures Corporation. Chargé de la planification stratégique, du développement et de l'amélioration des programmes de transactions, il est inscrit auprès de la Commodity Futures Trading Commission des États-Unis et de la CVMQ. M. Austrup est membre associé de la National Futures Association et membre de l'Association des fonds gérés (« MFA »). Il dirige de programme de deuxième cycle en finance quantitative à l'Université de Waterloo. Il a obtenu un B.A. avec distinction de l'Université Western Ontario.

| Série | Devises | Code de fonds |
|-------|---------|---------------|
| A     | CAD     | AHP 1100      |
| F     | CAD     | AHP 1110      |
| LL    | CAD     | AHP 1130      |

## Évaluation de risque

Faible Faible à Moyen Moyen Moyen à Élevé Élevé

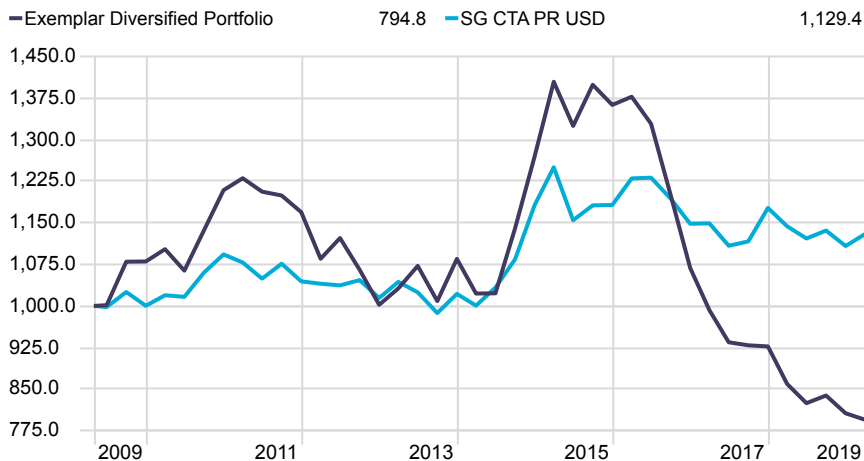
## Statistique de rendement

Time Period: 6/1/2009 to 3/31/2019

|                       | Fund A Class | SG CTA PR USD |
|-----------------------|--------------|---------------|
| Rendements cumulés    | -20.12       | 11.16         |
| Rendements annualisés | -2.26        | 1.08          |
| Écart type            | 12.48        | 7.81          |
| Alpha                 | -4.09        | 0.00          |
| Bêta                  | 0.60         | 1.00          |
| Corrélation           | 0.57         | 1.00          |
| Ratio d'encaissement  | 57.12        | 100.00        |
| Ratio de décaissement | 87.07        | 100.00        |
| Pic à creux maximal   | -46.46       | -14.26        |
| Ratio de Sharpe       | -0.18        | 0.19          |
| Ratio de Sortino      | -0.26        | 0.29          |

## Croissance des placements

Time Period: 5/2/2009 to 3/31/2019



## Rendements totaux

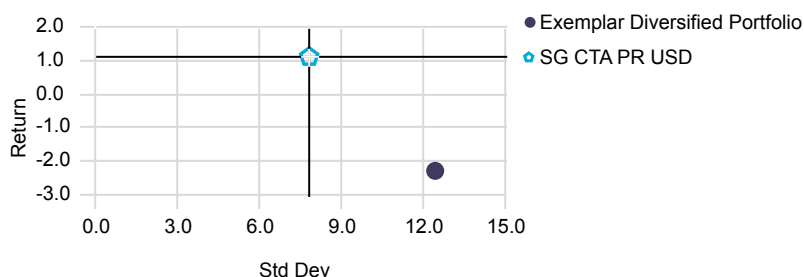
|                                | 1 mo | 3 mos | 6 mos | YTD   | 1 yr  | 3 yrs  | 5 yrs | ITD   |
|--------------------------------|------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|-------|
| Exemplar Diversified Portfolio | 0.38 | -1.43 | -5.19 | -1.43 | -7.51 | -16.74 | -4.91 | -2.26 |
| SG CTA PR USD                  | 3.45 | 1.93  | -0.58 | 1.93  | -1.25 | -2.80  | 2.45  | 1.08  |

## Rendements par année civile

|                                | 2018   | 2017   | 2016   | 2015 | 2014  | 2013 | 2012   | 2011  | 2010  | Partial 2009 |
|--------------------------------|--------|--------|--------|------|-------|------|--------|-------|-------|--------------|
| Exemplar Diversified Portfolio | -13.01 | -13.23 | -21.59 | 7.33 | 17.02 | 8.26 | -14.28 | -3.29 | 11.91 | 8.55         |
| SG CTA PR USD                  | -5.83  | 2.48   | -2.87  | 0.03 | 15.66 | 0.73 | -2.87  | -4.45 | 9.26  | -1.55        |

## Risque/rendement

Time Period: 6/1/2009 to 3/31/2019



## Précision sur le portefeuille

|   |               |
|---|---------------|
| Date de création                        | 5/1/2009      |
| Actif du portefeuille (en millions \$)  | \$ 11         |
| VL (fin de mois)                        | 7.95          |
| Frais de gestion de la catégorie A      | 2.00          |
| Indice du prospectus                    | SG CTA PR USD |
| Achat supplémentaire minimum            | 100           |
| Placement minimum (devise de référence) | 1,000         |

## Rendements mensuels

|      | janv. | févr.  | mars  | avr.  | mai   | juin  | juil. | août  | sept. | oct.  | nov.  | dec.  | année  |
|------|-------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|
| 2019 | -5.40 | 3.80   | 0.38  |       |       |       |       |       |       |       |       |       | -1.43  |
| 2018 | 6.60  | -10.88 | -2.42 | -0.06 | -3.06 | -0.94 | 0.22  | -0.28 | 1.74  | -7.11 | -0.01 | 3.55  | -13.01 |
| 2017 | -1.79 | -2.07  | -3.41 | -0.97 | -3.23 | -1.74 | 1.71  | 1.32  | -3.53 | -0.54 | -0.60 | 0.94  | -13.23 |
| 2016 | 3.12  | 1.39   | -3.32 | -3.40 | -4.92 | 5.02  | -0.45 | -6.13 | -3.32 | -5.10 | -5.86 | -0.36 | -21.59 |
| 2015 | 11.52 | -1.33  | 0.53  | -4.12 | 0.55  | -2.17 | 4.56  | 0.80  | 0.19  | -3.74 | 2.68  | -1.45 | 7.33   |
| 2014 | -3.04 | 1.08   | -3.84 | -0.02 | 0.01  | 0.05  | 5.10  | 3.28  | 2.67  | -0.51 | 8.50  | 3.19  | 17.02  |
| 2013 | 3.03  | -0.64  | 0.56  | 3.90  | -0.21 | 0.24  | -3.01 | -3.89 | 0.93  | 2.02  | 3.25  | 2.11  | 8.26   |
| 2012 | -2.86 | -2.88  | -1.61 | 3.06  | 6.99  | -6.18 | 1.09  | -1.56 | -4.62 | -4.89 | -1.61 | 0.52  | -14.28 |
| 2011 | -0.31 | 3.79   | -1.63 | 3.61  | -3.06 | -2.40 | 2.76  | 0.93  | -4.14 | -4.31 | 0.61  | 1.27  | -3.29  |
| 2010 | -3.37 | 2.24   | 3.29  | 0.18  | -3.46 | -0.23 | -3.85 | 9.27  | 1.70  | 5.42  | -1.97 | 2.92  | 11.91  |
| 2009 |       |        |       |       |       | 0.63  | 0.52  | 4.27  | 2.88  | -4.00 | 8.07  | -3.58 |        |

## Exposition sectorielle

au 31 mars 2019

Pondération

|                |        |
|----------------|--------|
| Agricultures   | 28.99% |
| Bonds          | 26.53% |
| Energies       | 12.40% |
| Equities       | 11.92% |
| Currencies     | 10.42% |
| Metals         | 6.94%  |
| Interest Rates | 2.80%  |

## 10 principaux placements

au 31 mars 2019

Pondération

|                      |       |
|----------------------|-------|
| 10 YR BOND           | 0.69% |
| PALLADIUM            | 0.59% |
| COFFEE C             | 0.59% |
| SFE AUSTRALIAN 10-YR | 0.53% |
| BRITISH LONG GILT    | 0.53% |
| RBOB GASOLINE        | 0.50% |
| MDEX PALM OIL        | 0.49% |
| US T BONDS           | 0.48% |
| US 10YR NTE          | 0.44% |
| BRENT CRUDE          | 0.43% |

À moins d'indications contraires, les rendements du portefeuille Exemplar concernent les parts de catégorie A et s'entendent en dollars canadiens, après prise en compte de tous les frais et réinvestissement de toutes les distributions. Un placement dans un portefeuille Exemplar peut donner lieu à des commissions, des commissions de suivi, des frais de gestion et autres dépenses. Veuillez lire le prospectus avant de faire un placement. Sauf indication contraire, chaque taux de rendement indiqué est un taux de rendement total composé annuel historique qui tient compte des fluctuations de la valeur des parts et du réinvestissement de tous les dividendes ou de toutes les distributions et qui ne tient pas compte des commissions d'achat et de rachat, des frais de placement ni des frais optionnels ou de l'impôt sur le revenu payables par un porteur, qui auraient pour effet de réduire le rendement. Les portefeuilles Exemplar ne sont pas couverts par la Société d'assurance-dépôts du Canada (SADC) ni par un autre assureur. Les Portefeuilles Exemplar comportent un risque de perte du capital et du revenu, et leur valeur change fréquemment. Le rendement passé n'est pas indicatif du rendement futur. Les actions du Portefeuille sont très spéculatives et comportent un degré élevé de risque. Vous pouvez perdre une portion substantielle et même la totalité du capital investi dans un Portefeuille. Les positions du portefeuille, notamment les 10 principales, sont soumises à changement sans préavis.

Source: Morningstar Direct 2019 Morningstar Research Inc. Tout droit réservé. Les renseignements aux présentes appartiennent à Morningstar ou à ses fournisseurs de contenu. Ils ne peuvent être reproduits ou distribués et ne sont pas réputés comme étant exacts, complets ou à propos. Morningstar et ses fournisseurs ne sont pas responsables des dommages ou des pertes survenant de l'utilisation de ces renseignements. Le rendement passé n'est pas indicatif du rendement futur. Ce document contient des avis juridiques.