

Portefeuilles Exemplar diversifié (F)

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 Élevé

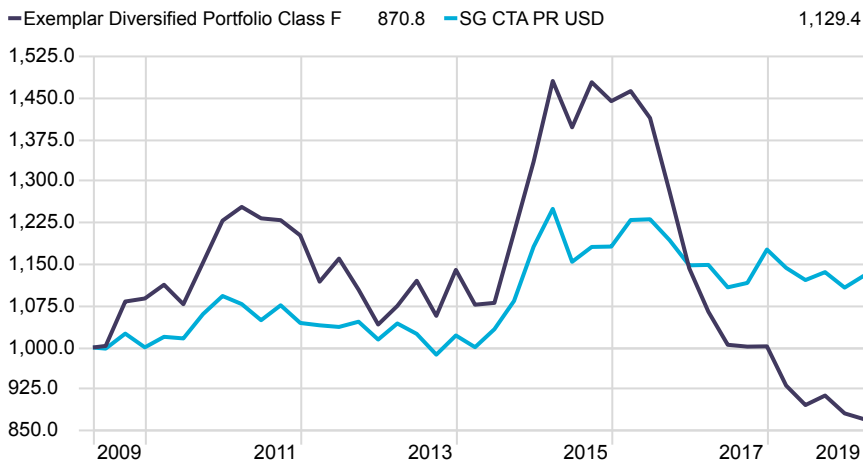
Statistique de rendement

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

	Fund A Class	SG CTA PR USD
Rendements cumulés	-12.54	11.16
Rendements annualisés	-1.35	1.08
Écart type	12.35	7.81
Alpha	-3.16	0.00
Bêta	0.59	1.00
Corrélation	0.57	1.00
Ratio d'encaissement	59.51	100.00
Ratio de décaissement	83.32	100.00
Pic à creux maximal	-44.85	-14.26
Ratio de Sharpe	-0.11	0.19
Ratio de Sortino	-0.16	0.29

Croissance des placements

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



Rendements totaux

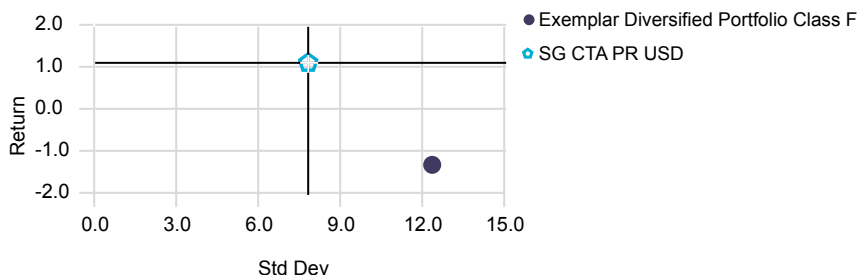
	1 mo	3 mos	6 mos	YTD	1 yr	3 yrs	5 yrs	ITD
Exemplar Diversified Portfolio Class F	0.46	-1.18	-4.66	-1.18	-6.51	-15.87	-4.16	-1.35
SG CTA PR USD	3.45	1.93	-0.58	1.93	-1.25	-2.80	2.45	1.08

Rendements par année civile

	2018	2017	2016	2015	2014	2013	2012	2011	2010	Partial 2009
Exemplar Diversified Portfolio Class F	-12.06	-12.33	-20.87	8.19	17.11	9.46	-13.37	-2.17	12.90	9.32
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)	8.71
Frais de gestion de la catégorie F	1.00
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	-5.31	3.89	0.46										-1.18
2018	6.71	-10.81	-2.34	0.03	-2.98	-0.86	0.31	-0.19	1.79	-6.99	0.08	3.64	-12.06
2017	-1.69	-1.99	-3.33	-0.90	-3.14	-1.66	1.80	1.40	-3.45	-0.45	-0.51	1.02	-12.33
2016	3.24	1.46	-3.33	-3.32	-4.84	5.08	-0.39	-6.01	-3.25	-5.02	-5.78	-0.28	-20.87
2015	11.57	-1.17	0.58	-4.16	0.58	-2.12	4.62	0.88	0.26	-3.61	2.70	-1.31	8.19
2014	-2.95	1.16	-3.75	0.06	0.09	0.15	5.19	3.36	2.76	-0.42	7.55	3.26	17.11
2013	3.13	-0.56	0.65	4.00	-0.12	0.32	-2.92	-3.80	1.02	2.12	3.34	2.20	9.46
2012	-2.78	-2.80	-1.53	3.15	6.95	-5.98	1.18	-1.47	-4.54	-4.80	-1.53	0.61	-13.37
2011	-0.22	3.83	-1.53	3.67	-2.98	-2.21	2.77	1.01	-3.93	-4.21	0.70	1.36	-2.17
2010	-3.27	2.32	3.34	0.25	-3.26	-0.14	-3.76	9.20	1.77	5.48	-1.88	2.98	12.90
2009						0.72	0.63	4.36	2.83	-3.64	8.08	-3.50	

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 NOTE	0.44%
BRENT CRUDE	0.43%

À moins d'indications contraires, les rendements du portefeuille Exemplar concernent les parts de catégorie F 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.