

PORTEFEUILLE EXEMPLAR DIVERSIFIÉ

Information trimestrielle sur le Portefeuille - Au 30 septembre 2016

| Pondération par secteur | Exposition à long terme [†] (%) | Exposition à court terme [†] (%) | 25 principaux titres en portefeuille [†] | % |
|--|--|---|---|----------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligations | 133,7 | (147,4) | Positions acheteur | |
| Contrats à terme standardisés sur marchandises | 58,5 | (34,4) | 90DAY BANK ACCEPT FUTURE (MSE) | 171,6 |
| Contrats à terme standardisés sur taux d'intérêt | 219,6 | (138,7) | Cash and Cash Equivalents | 99,0 |
| Contrats à terme standardisés sur monnaies | 58,9 | (43,4) | US 5YR TREAS NTS FUTURE (CBT) | 48,5 |
| Contrats à terme standardisés sur indices | 49,0 | - | 90DAY EURODOLLAR FUTURE (CME) | 41,2 |
| Options | 0,3 | - | US 10YR TREAS NTS FUTURE (CBT) | 34,6 |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie | 99,0 | - | CANADA 10YR BOND FUTURE (MSE) | 23,8 |
| Autres actifs (passifs) | 0,1 | - | JPN YEN CURR FUTURE (CME) | 18,7 |
| | 619,1 | (363,9) | UK LONG GILT FUTURE (LIF) | 15,6 |
| | | | AUDUSD CRNCY FUTURE (CME) | 15,1 |
| | | | EURO/GBP FUTURE (CME) | 14,1 |
| | | | NASDAQ 100 E-MINI FUTURE (CME) | 13,2 |
| | | | SUGAR #11 WORLD FUTURE (NYB) | 13,1 |
| | | | S&P/TSE 60 INDEX FUTURE (MSE) | 12,0 |
| | | | US TREAS BD FUTURE (CBT) | 11,2 |
| | | | HANG SENG INDEX FUTURE (HKG) | 10,4 |
| | | | WHITE SUGAR (ICE) FUTURE | 9,7 |
| | | | CRUDE PALM OIL FUTURE (MDE) | 8,0 |
| | | | BRAZIL REAL FUTURE (CME) | 7,9 |
| | | | Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale | 567,7 |
| | | | Positions vendeur | |
| | | | 3MO EURO EURIBOR FUTURE (LIF) | (138,7) |
| | | | EURO-BOBL FUTURE (EUX) | (68,5) |
| | | | EURO-BUND FUTURE (EUX) | (38,2) |
| | | | JAPAN 10YR MINI BD FUTURE(SGX) | (35,1) |
| | | | MEXICAN PESO FUTURE (CME) | (17,1) |
| | | | EURO/JPY FUTURE (CME) | (13,0) |
| | | | BP CURRENCY FUTURE (CME) | (10,4) |
| | | | Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale | (321,0) |
| | | | Total (%) | 246,7 |
| | | | Total de la valeur liquidative (en millions \$) | 51,3 |

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 théoriques.