

CATÉGORIE WAVEFRONT PLACEMENT DIVERSIFIÉ MONDIAL

Information trimestrielle sur le Portefeuille - Au 31 mars 2020

Répartition du portefeuille			Les 25 principaux titres	
Répartition sectorielle	% de la valeur liquidative		Émetteur/Fonds sous-jacent	% de la valeur liquidative
Contrats à terme normalisés sur obligations	0.5	(0.0)	Positions acheteur	
Contrats à terme normalisés sur marchandises	5.1	(0.6)	Contrats à terme normalisés sur les acceptations bancaires à 90 jours	154.4
Contrats à terme normalisés sur devises	0.5	(0.4)	Contrats à terme normalisés sur les acceptations bancaire	82.9
Contrats à terme normalisés sur indices	0.0	(0.1)	Contrats à terme normalisés Euribor 3 mois	40.7
Contrats à terme normalisés sur taux d'intérêt	0.1	(0.0)	Contrats à terme normalisés sur obligations de 5 ans du Trésor des États-Unis	23.3
Options	0.3	-	Contrats à terme normalisés mini sur obligations à 10 ans de l'État japonais	12.4
Trésorerie et équivalents de trésorerie	231.7	(136.1)	Contrats à terme normalisés sur obligations de 10 ans du Trésor des États-Unis	12.1
Autres actifs (passifs)	-	(1.0)	Contrats à terme normalisés sur obligations de 10 ans du Canada	9.1
Total	238.3	(138.3)	Contrats à terme normalisés sur gilts position acheteur	7.4
			Contrats à terme normalisés EURO/GBP	6.0
			Contrats à terme normalisés sur le blé	4.7
			Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	353.0
			Positions vendeur	
			Contrats à terme normalisés EURO-BOBL	(32.6)
			Contrats à terme normalisés Euribor 3 mois	(27.2)
			Contrats à terme normalisés EURO/CHF	(15.0)
			Contrats à terme normalisés sur l'aluminium PRI	(10.4)
			Contrats à terme normalisés sur le zinc	(8.8)
			Contrats à terme normalisés AUD USD	(8.1)
			Contrats à terme normalisés sur le dollar canadien	(7.8)
			Contrats à terme normalisés sur le maïs	(6.7)
			Contrats à terme normalisés sur le canola	(5.8)
			Contrats à terme normalisés sur l'huile de soya	(4.8)
			Contrats à terme normalisés sur le coton n 2	(4.7)
			Contrats à terme normalisés sur le réal brésilien	(4.6)
			Contrats à terme normalisés EURO/JPY	(4.5)
			Contrats à terme normalisés sur le nickel	(4.5)
			Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	(145.6)
			Total (%)	207.5
			Total de la valeur liquidative (en millions \$)	12.9

"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.