

CATÉGORIE WAVEFRONT PLACEMENT DIVERSIFIÉ MONDIAL

(auparavant, Portefeuille diversifié Exemplar)

Information trimestrielle sur le Portefeuille - Au 30 septembre 2019

Répartition sectorielle	Exposition à long terme † (%)	Exposition à court terme † (%)	Les 25 principaux titres†	%
Contrats à terme standardisés sur obligations	0,2	(0,4)	Positions acheteur	
Contrats à terme standardisés sur marchandises	0,8	(2,1)	Contrats à terme normalisés sur taux Euribor de 3 mois	15,2
Contrats à terme standardisés sur taux d'intérêt	0,2	(0,2)	Contrats à terme normalisés sur les acceptations bancaires de 90 jpur	11,2
Contrats à terme standardisés sur monnaies	0,0	(0,2)	Contrats à terme normalisés sur l'euro de 90 jours	11,1
Contrats à terme standardisés sur indices	0,0	(0,2)	Contrats à terme normalisés sur les acceptations bancaires	10,1
Options	0,2	0,0	Espèces et quasi-espèces	9,3
Espèces et quasi-espèces	327,9	(225,3)	Contrats à terme normalisés sur la livre sterling à 90 jours	8,3
Autres actifs (passifs)	0,0	(1,2)	Contrats à terme normalisés sur obligations de 5 ans du Trésor des États-Unis	7,6
	329,5	(229,5)	Contrats à terme sur obligations canadiennes à 10 ans	7,0
			Contrats à terme normalisés sur gilts position acheteur	5,6
			Contrats à terme normalisés sur obligations de 10 ans du Trésor des États-Unis	5,5
			Contrats à terme normalisés sur obligations de 10 ans de l'Australie	5,3
			Contrats à terme normalisés sur obligations du Trésor américain	5,1
			Contrats à terme normalisés sur le peso mexicain	5,0
			Contrats à terme normalisés sur le bétail vivant	3,9
			Contrats à terme normalisés E-mini sur l'indice S&P 500	3,8
			Contrats à terme normalisés sur le gaz et le pétrole	3,4
			Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	117,3
			Positions vendeur	
			Contrats à terme normalisés mini sur obligations à 10 ans du Japon	(1,3)
			Contrats à terme normalisés EURO-BOBL	(1,3)
			Contrats à terme normalisés EURO/CHF	(0,8)
			Contrats à terme normalisés sur le dollar canadien	(0,5)
			Contrats à terme normalisés sur l'euro FX	(0,2)
			Contrats à terme normalisés sur le canola	(0,2)
			Contrats à terme normalisés EURO-BUND	(0,2)
			Contrats à terme normalisés sur le pétrole brut	(0,1)
			Contrats à terme normalisés EURO/GBP	(0,1)
			Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	(4,7)
			Total (%)	112,6
			Total de la valeur liquidative (en millions \$)	7,8

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.