

FONDS ALTERNATIF FORTIFIÉ ALPHA PICTON MAHONEY — F

31 mars 2024

**Renseignements sur le Fonds**

**Date de création :**

3 mai 2022

**Taille du fonds :**

\$ 394,65MM

**Frais de gestion :**

0,95 %

**Frais liés au rendement :**

20,00 %<sup>^</sup>

**Taux de rendement minimal :**

2,00 %

**Seuil de rendement perpétuel :**

Oui

**Stratégie du fonds :**

Stratégie multiactifs

**Cadre du fonds :**

Fonds commun de placement alternatif (prospectus simplifié)

<sup>^</sup> de la portion du rendement supérieur à un taux de rendement minimal de 2 %, y compris un seuil de rendement perpétuel

**Gestion de portefeuille**



**Neil Simons**

Gestionnaire de portefeuille, stratégies multi-actifs



**Dashmeet Singh**

Gestionnaire de portefeuille et directeur, risque et recherches quantitatives

**Objectif de placement du fonds**

La stratégie devrait combiner les meilleures idées de l'entreprise en déployant l'expertise en investissement des équipes des actions, des titres à revenu fixe et de l'arbitrage et l'équipe quantitative. La faible corrélation entre ces composantes et les marchés boursiers visera à améliorer les rendements ajustés au risque.

**Pourquoi investir dans ce fonds?**

**ACCÈS À DIVERSES STRATÉGIES DE PLACEMENT ALTERNATIVES**

Le Fonds cherchera à offrir une exposition à diverses stratégies de Fonds alternatifs fortifiés qui, historiquement, n'ont pas été corrélées aux placements traditionnels en actions et titres à revenu fixe.

**MISE À PROFIT DES COMPÉTENCES DE GESTIONNAIRES CHEVRONNÉS**

Qui gèrent des stratégies de fonds de couverture authentiques depuis plus d'une décennie.

**ATTÉNUATION DU RISQUE ET GESTION DE LA LIQUIDITÉ**

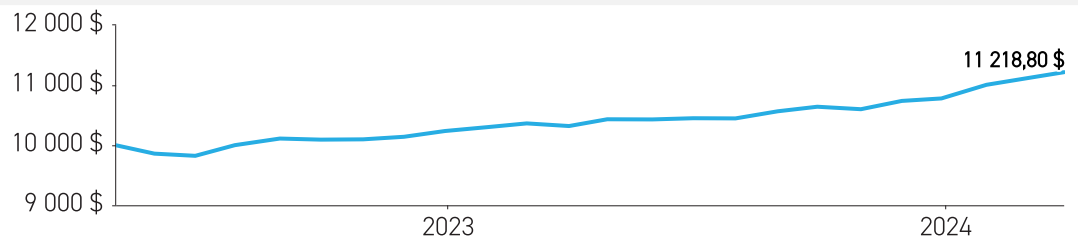
Qui visent à tirer son alpha de facteurs qui n'aggravent pas les risques du portefeuille (comme les risques liés aux actions et aux taux d'intérêt). Le Fonds prévoira également une liquidité suffisante.

**Risque: Faible à moyen**



**Croissance de 10 000\$** Au 31 mars 2024

Valeur d'investissement: **11 218,80 \$** au 28 mars 2024



**Rendements composés †** Au 31 mars 2024

	1 mois	3 mois	6 mois	AAJ	1 an	3 ans*	5 ans*	10 ans*	Depuis la création*
Fonds alternatif fortifié alpha Picton Mahoney F	0,92 %	4,06 %	5,41 %	4,06 %	8,70 %	—	—	—	6,23 %
Indice <sup>1</sup>	4,14 %	6,62 %	15,26 %	6,62 %	13,96 %	—	—	—	6,60 %

<sup>1</sup> S&P/TSX Composite TR Index

† Le taux de rendement indiqué ci-dessus est utilisé uniquement pour illustrer les effets du taux de croissance composé et ne vise pas à refléter les valeurs futures du fonds d'investissement, ni le rendement des investissements dans le fonds d'investissement.

\* fait référence au rendement annualisé moyen.

**Rendement annuel** Au 31 mars 2024

Fonds alternatif fortifié alpha Picton Mahoney F	Indice <sup>1</sup>
<b>2023</b>	11,75 %
	5,30 %

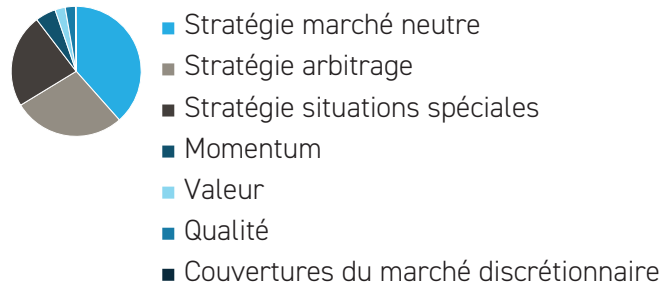
<sup>1</sup> S&P/TSX Composite TR Index

**Mesures du risque sur**

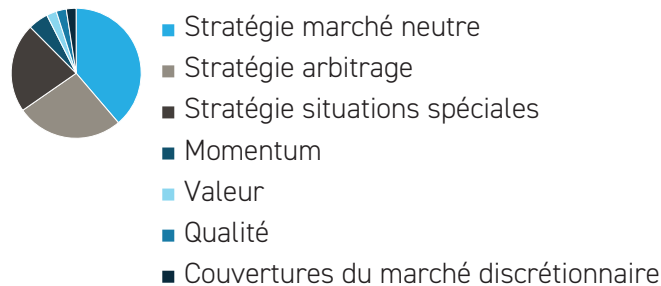
Statistiques relatives au risque et au rendement	Fonds	Indice
Rendement annualisé	6,23 %	6,60 %
Écart-type annualisé	2,43 %	15,51 %
Ratio de Sharpe	1,25	0,25
Bêta	0,05	—
Taux de capture à la hausse	19,81 %	—
Taux de capture à la baisse	-8,85 %	—
Baisse maximale	-2,07 %	-12,91 %
Date de la valeur de pointe du prélèvement maximal	2022-05-06	2022-05-09
Valeur résiduelle Date du prélèvement maximal	2022-06-23	2022-07-14

## Composition du portefeuille Au 31 mars 2024

### Répartition en dollars



### Répartition selon le risque



### Frais

Série(s)	Frais de gestion	Codes de fonds
Catégorie A	1,95 %	PIC 3350
FNB	0,95 %	PFAA
Catégorie F	0,95 %	PIC 3351
Catégorie FT	0,95 %	PIC 3353

Ce document est destiné à être utilisé par des conseillers en placements.

Il n'y a aucune garantie qu'une stratégie de couverture sera fructueuse ou qu'elle produira les résultats voulus. Le recours aux instruments dérivés et aux ventes à découvert comporte plusieurs risques susceptibles d'empêcher une stratégie de réaliser des gains ou de limiter ses pertes, ou de l'amener à subir des pertes. Le recours aux instruments dérivés et aux ventes à découvert dans le cadre d'une stratégie de couverture peut donner lieu à des coûts et dépenses supplémentaires.

Il est fourni uniquement à titre de source d'information générale, il peut être modifié sans préavis et il ne doit pas être assimilé à des conseils de placement. Le présent document ne doit pas servir à la prise de toute décision de placement et ne constitue pas une recommandation, une sollicitation ou une offre de titres dans quelque territoire que ce soit.

Un placement dans un fonds commun de placement peut donner lieu à des commissions de vente, des commissions de suivi, des frais de gestion, des frais liés au rendement et d'autres frais. Veuillez lire le prospectus avant d'investir. Les fonds communs de placement ne sont pas garantis, leur valeur change fréquemment et leur rendement antérieur ne se répète pas forcément. Les titres des fonds alternatifs peuvent être achetés seulement par l'intermédiaire d'un courtier inscrit et ne sont offerts que dans les territoires où la loi en autorise la vente.