

FONDS ALTERNATIF FORTIFIÉ MULTI-STRATÉGIES PICTON MAHONEY — FT

31 mars 2024

Renseignements sur le Fonds

Date de création :

13 juillet 2021

Taille du fonds :

\$ 61,64MM

Frais de gestion :

0,95 %

Frais liés au rendement :

20,00 %[^]

Taux de rendement minimal :

2,00 %

Seuil de rendement perpétuel :

Oui

Distributions :

Mensuelles; ciblant un taux annuel de 5 %

Stratégie du fonds :

Stratégie multiactifs

Cadre du fonds :

Fonds commun de placement alternatif (prospectus simplifié)

[^] 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

Objectif de placement du fonds

L'objectif de placement du Fonds consiste à offrir aux investisseurs une plus-value du capital à long terme cohérente et un taux de rendement ajusté au risque intéressant sur un cycle de marché complet. Le Fonds utilise un processus d'investissement exclusif à plusieurs niveaux qui repose sur des techniques modernes de construction de portefeuille pour déterminer la répartition de l'actif, et qui fait appel à un ensemble complet de catégories d'actifs traditionnelles et alternatives, de stratégies axées sur l'exposition au risque factoriel et de processus producteurs d'alpha. Une couverture discrétionnaire est disponible en vue d'améliorer de manière tactique le rendement du Fonds.

Pourquoi investir dans ce fonds?

ÉLARGISSEZ LES OCCASIONS DE GÉNÉRER DE L'ALPHA

Au moyen d'un Fonds dont l'objectif est d'accroître le potentiel de rendement tout en étant exposé à un taux de volatilité semblable à celui des marchés boursiers traditionnels.

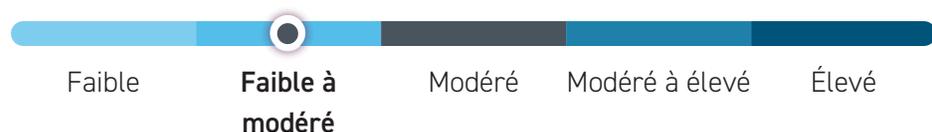
TIREZ PROFIT DE GESTIONNAIRES CHEVRONNÉS

Qui gèrent des stratégies de couverture authentiques[®] depuis plus de 10 ans.

AJOUTEZ DES OUTILS DE COUVERTURE

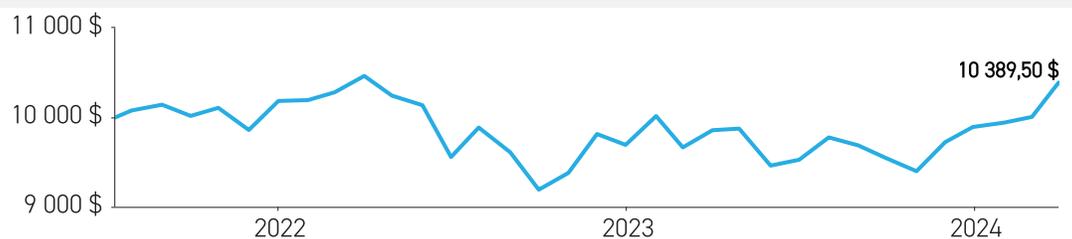
Pour améliorer les portefeuilles traditionnels composés de positions exclusivement acheteur.

Risque: Faible à moyen



Croissance de 10 000\$ Au 31 mars 2024

Valeur d'investissement: 10 389,50 \$ au 28 mars 2024





Michael White
Gestionnaire de portefeuille, stratégies multi-actifs



Dashmeet Singh
Gestionnaire de portefeuille et directeur, risque et recherches quantitatives

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 multi-stratégies Picton Mahoney – Catégorie de FNB FT	3,84 %	5,02 %	8,84 %	5,02 %	5,41 %	—	—	—	1,42 %
Indice ¹	2,60 %	5,25 %	11,21 %	5,25 %	13,05 %	—	—	—	3,88 %

¹ 5 % indice des bons du Trésor à 30 jours FTSE, 40 % indice mondial MSCI de RT 100 % couvert en \$ CA, 5 % indice du prix de l'or LMBA, 40 % indice ICE BofA Global Broad Market (couvert en \$ CA) et 10 % indice de RT S&P GSCI couvert en \$ CA

† 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 multi-stratégies Picton Mahoney – Catégorie de FNB FT	Indice ¹
2022	-4,82 %	-8,93 %
2023	2,06 %	11,88 %

¹ 5 % indice des bons du Trésor à 30 jours FTSE, 40 % indice mondial MSCI de RT 100 % couvert en \$ CA, 5 % indice du prix de l'or LMBA, 40 % indice ICE BofA Global Broad Market (couvert en \$ CA) et 10 % indice de RT S&P GSCI couvert en \$ CA

Mesures du risque sur

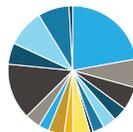
Statistiques relatives au risque et au rendement	Fonds	Indice **
Rendement annualisé	1,42 %	3,88 %
Écart-type annualisé	9,11 %	9,28 %
Ratio de Sharpe	-0,14	0,13
Bêta	0,89	—
Taux de capture à la hausse	81,84 %	—
Taux de capture à la baisse	96,92 %	—
Baisse maximale	-13,61 %	-13,10 %

Statistiques relatives au risque et au rendement	Fonds	Indice **
Date de la valeur de pointe du prélèvement maximal	2022-03-24	2021-11-09
Valeur résiduelle Date du prélèvement maximal	2022-09-26	2022-09-30

****5 % indice des bons du Trésor à 30 jours FTSE, 40 % indice mondial MSCI de RT 100 % couvert en \$ CA, 5 % indice du prix de l'or LMBA, 40 % indice ICE BofA Global Broad Market (couvert en \$ CA) et 10 % indice de RT S&P GSCI couvert en \$ CA**

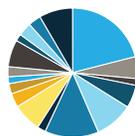
Composition du portefeuille Au 29 février 2024

Répartition en dollars



- Taux d'intérêt
- Écart des titres à rendement élevé
- Écart des titres de qualité supérieure
- Métaux précieux
- Métaux industriels
- Énergie
- Grains
- Actions des marchés développés
- Actions des marchés émergents
- Momentum
- Valeur
- Qualité
- Fonds alternatif fortifié marché neutre Picton Mahoney
- Fonds alternatif fortifié de revenu Picton Mahoney
- Fonds alternatif fortifié d'arbitrage plus Picton Mahoney
- Fonds alternatif fortifié de situations spéciales Picton Mahoney
- Couvertures du marché discrétionnaire

Répartition selon le risque



- Taux d'intérêt
- Écart des titres à rendement élevé
- Écart des titres de qualité supérieure
- Métaux précieux
- Métaux industriels
- Énergie
- Grains
- Actions des marchés développés
- Actions des marchés émergents
- Momentum
- Valeur
- Qualité
- Fonds alternatif fortifié marché neutre Picton Mahoney
- Fonds alternatif fortifié de revenu Picton Mahoney
- Fonds alternatif fortifié d'arbitrage plus Picton Mahoney
- Fonds alternatif fortifié de situations spéciales Picton Mahoney
- Couvertures du marché discrétionnaire

Frais

Série(s)	Frais de gestion	Codes de fonds
FNB	0,95 %	PFMS
Catégorie A	1,95 %	PIC 3600
Catégorie F	0,95 %	PIC 3601
Catégorie FT	0,95 %	PIC 3603

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.