

INFORMATION GÉNÉRALE

Type de stratégie	Revenu fixe core
Indice	Indice obligataire universel Canada FTSE
Structure	Société en commandite
Gestionnaire de portefeuille	Groupe Nymbus Capital
Gestionnaire de fonds	Gestion de placements Innocap inc.
Administrateur	Apex Fund Services
Fiduciaire	Northern Trust
Devise	CAD
Lancement	1 Février 2019
Frais de gestion	0.27%

DÉTAILS DE LA STRATÉGIE



DESCRIPTION DE LA STRATÉGIE

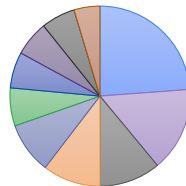
L'objectif du fonds est de reproduire et de générer des rendements supérieurs à ceux de l'indice obligataire universel FTSE Canada. Le fonds investit dans des titres à revenu fixe, tels que des obligations gouvernementales et de sociétés, des titres adossés à des actifs, du papier commercial et des fonds d'obligations. Le fonds utilise une approche quantitative qui tire parti de technologie moderne telle que le Big Data, l'apprentissage automatique et l'informatique distribuée pour sélectionner des titres présentant des caractéristiques souhaitables pour le portefeuille. Le fonds se concentre sur l'univers du marché obligataire canadien, mais peut investir dans d'autres pays et peut utiliser des dérivés de taux de change et de taux d'intérêt pour réduire l'exposition aux risques.

Perf. brute	janv.	févr.	mars	avr.	mai	juin	juil.	août	sept.	oct.	nov.	déc.	AAD
2020	2.87%	0.54%	-4.90%	4.53%	0.36%	2.36%	2.18%	-0.63%	0.21%	-0.63%	1.96%	1.08%	10.05%
2019		0.30%	2.33%	0.08%	1.65%	1.07%	0.39%	1.67%	-0.56%	-0.19%	0.63%	-0.88%	6.63%

CARACTÉRISTIQUES DU FONDS

	Nymbus	Indice	Différence
Durée pondérée	8.17	8.74	-0.56
Rendement effectif	2.67%	1.68%	0.98%
Cote de crédit pondérée	A	AA-	-
Prob. défaut; horizon 5ans	1.56%	6.51%	-4.95%
Cote de liquidité	79.1%	89.7%	-10.6%

10 PRINCIPAUX ACTIFS



- ACM Commercial Mortgage Fund
- PROVINCE OF ALBERTA 4.5% 12-01-40
- PROVINCE OF NEWFOUNDLAND 2.3% 06-02-25
- PROVINCE OF NEWFOUNDLAND 2.9% 06-02-28
- PROVINCE OF ALBERTA 3.1% 12-01-48
- BANK OF MONTREAL 4.3% 11-26-80
- COAST CAPITAL SV CRE UN 5.0% 05-03-23
- TERANET HOLDINGS LP 6.1% 06-17-41
- ENBRIDGE INC 5.4% 09-27-27
- Mackenzie Floating Rate Income

ANALYSE DE RISQUE* (net de frais)

	Ratio Sharpe	Ratio d'information	0.05
Ratio Sortino	1.00	Retrenchement maximal	-5.0%
VAR (-90%)	0.85%	Temps de recouvrement	4 mois
Capture des hausses	113.7%	Périodes positives (%)	73.9%
Capture des baisses	129.9%	Périodes négatives (%)	26.1%

GESTIONNAIRE DE PORTEFEUILLE



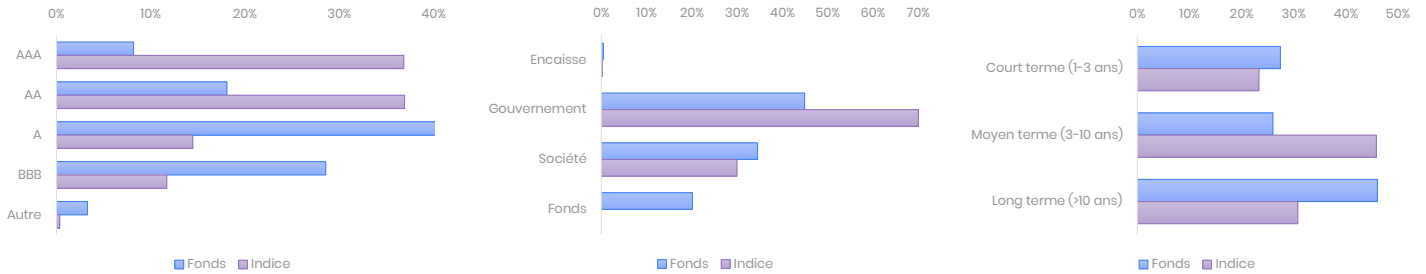
GABRIEL CEFALONI
Chef de placements
Expérience marchés capitaux: 12 ans
Expertise: Revenu fixe, dérivés, maths appliqués & science informatique



MARC RIVET
Chef de la conformité et des risques
Expérience marchés capitaux: 32 ans
E: mrivet@nymbus.ca
T: 514-667-0050
M: 514-862-0366

CONTACT

POSITIONNEMENT



	Rendements totaux			Rendements annualisés				Métriques de risque annualisé			
	1 Mois	3 Mois	AAD (2020)	1 An	2 Ans	3 Ans	5 Ans	Depuis Lancement	Écart-type (Lancement)	Ratio Sharpe (Lancement)	Corrélation
Nymbus Revenu Fixe Cdn Quant	1.08%	2.41%	10.05%	10.05%				8.76%	6.09%	1.09	0.93
NYM RFCQ: net des frais de gestion	1.05%	2.34%	9.80%	9.78%				8.49%	6.09%	1.05	0.93
NYM RFCQ: net de tous frais	1.00%	2.18%	9.02%	9.02%				7.72%	6.09%	0.92	1.00
Indice obligataire universel Canada FTSE	0.37%	0.51%	8.56%	8.56%				7.32%	4.69%	1.11	0.93
Déviations (avant frais)	0.71%	1.90%	1.49%	1.49%				1.44%	1.40%	-0.02	0.00

* Ces informations ne reflètent pas les performances attendues de la stratégie et sont fournies uniquement dans le but d'illustrer l'expérience de Nymbus Capital Group Inc. Ces informations ne sont pas et ne doivent pas être interprétées comme représentant les performances futures des titres ou des montants, le cas échéant, distribué par le ou les fonds. Les informations fournies dans ce document ne constituent pas un conseil en investissement et ne doivent pas être interprétées comme une sollicitation d'achat ou une offre de vente d'un titre. Ils ne tiennent pas compte des objectifs de placement, des stratégies de placement, de la situation fiscale ou de l'horizon de placement d'un investisseur. Il n'y a aucune représentation, garantie ou responsabilité pour l'exactitude des décisions basées sur ces données. Les performances passées ne garantissent pas les résultats futurs. Les données relatives aux stratégies de Nymbus Capital ne doivent pas être interprétées comme une offre publique de valeurs mobilières dans quelque juridiction que ce soit au Canada. Les parts des stratégies Nymbus Capital sont offertes conformément à leur politique de placement respective et à l'acte de fiducie, seuls les investisseurs résidant au Canada et répondant à certaines conditions d'éligibilité et de souscription minimum. Vous trouverez des informations importantes sur les stratégies de Nymbus Capital, notamment un énoncé de leur objectif de placement, dans leur politique de placement respective et dans l'acte de stratégie, que vous pouvez obtenir auprès de Nymbus Capital. La valeur des unités et les rendements fluctuent. Les données de performance présentées dans ce document ne sont pas auditées et comprennent les frais de gestion et les charges du fonds. Veuillez lire attentivement les politiques de placement et les accords de fiducie avant d'investir. Toutes les données de performance impliquent le réinvestissement de distributions ou de dividendes et ne tiennent pas compte des autres frais ni des autres impôts sur le revenu à payer par le porteur de parts qui réduisent les rendements. Les stratégies ne sont pas garanties, leurs valeurs changent fréquemment et les performances passées peuvent ne pas être répétées. Le FNB iShares Core Universal Bond Universe est utilisé comme proxy pour l'indice obligataire universel FTSE Canada dans le cadre d'une analyse des constituants et des caractéristiques. Les points de données de l'analyse des risques sont calculés sur la base des performances mensuelles et ne reflètent pas les fluctuations journalières ou infra-journalières.