Fonds Alternatif D'indicateurs Canadiens Ameliores Accelerate

TSX ATSX

Au 29 février 2024

Type	Structure	Date de création	Frais de gestion	Valeur liquidative
Alpha + Beta	FNB alternatif	10 mai 2019	0,00%	23,67$

Gestionnaire	Distributions	Bourse	Devise	Rendement de Distribution
Accelerate	0,42$ par trimestre	TSX	CAD	7,10%

Cote de risque	Prime de performance/seuil butoir
Moyen	1/2 de l'excédent sur le seuil de performance/rendement S&P/TSX 60

1 mois	3 mois	Cumul de l'année	1 an	3 ans	Depuis la création
1,3%	7,7%	4,7%	10,2%	11,0%	8,4%

À propos du fonds

Le Fonds alternatif d'indicateurs canadiens améliorés Accelerate (TSX: ATSX) combine une exposition au S&P/TSX 60 à une gestion superposée de positions acheteur-vendeur de titres canadiens cherchant un rendement graduel supérieur à celui de l'indice boursier canadien dans son ensemble.

Objectifs des placements Modèle de placement

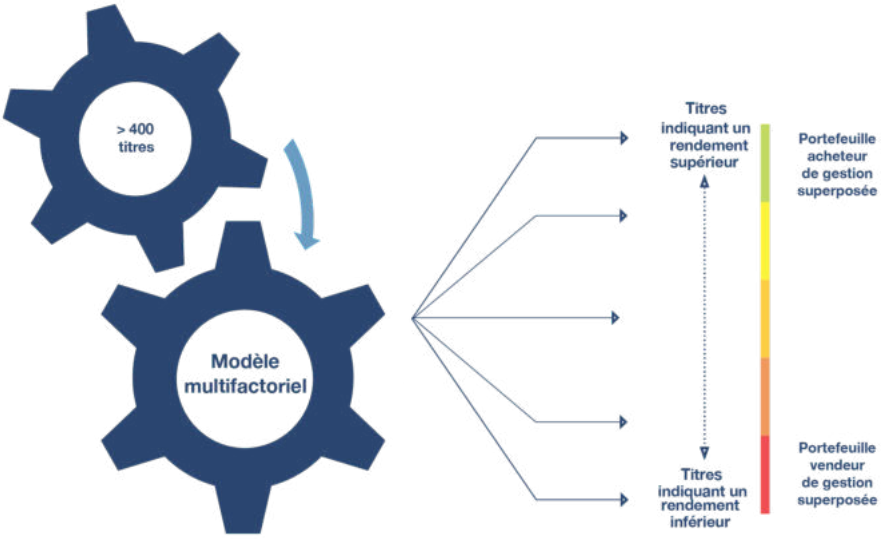
- Rendement supérieur à l'indice boursier canadien dans son ensemble
- Volatilité ajustée à celle de l'indice boursier canadien dans son ensemble

Modèle de placement

Le fonds offre une exposition à l'indice boursier canadien dans son ensemble, par l'entremise de produits dérivés, de FNB ou d'actions sous-jacentes, et à une gestion superposée diversifiée de positions acheteur-vendeur de titres canadiens.

Pour sélectionner les titres du portefeuille de gestion superposée, ATSX se sert d'un modèle multifactoriel exclusif qui permet de trier et de catégoriser les titres canadiens en fonction de cinq facteurs principaux:

• Valeur • Qualité • Dynamique du cours • Dynamique d'exploitation • Tendance



Le portefeuille de superposition de fonds adopte une position acheteur à l'égard des titres offrant le plus grand potentiel (décile supérieur du modèle multifactoriel) et une position vendeur à l'égard des titres du décile inférieur. Le portefeuille acheteur détient les titres jusqu'à environ 50% de la valeur liquidative et le portefeuille vendeur détient les titres jusqu'à -50% de la valeur liquidative. Le portefeuille de gestion superposée est rééquilibré sur une base mensuelle.

DÉNI DE RESPONSABILITE: Le rendement antérieur ne reflète pas un rendement futur. Des frais de négociation et de rémunération au rendement estimés ont été déduits des résultats indiqués. Les placements comportent un niveau de risque variable et aucune garantie de profit ne peut être offerte à l'égard du rendement futur de toute stratégie d'investissement. Ce document ne constitue pas des conseils en matière de placement. Pour une liste complète des valeurs mobilières, veuillez consulter www.AccelerateShares.com.

Fonds Alternatif D'indicateurs Canadiens Ameliores Accelerate

Au 29 février 2024

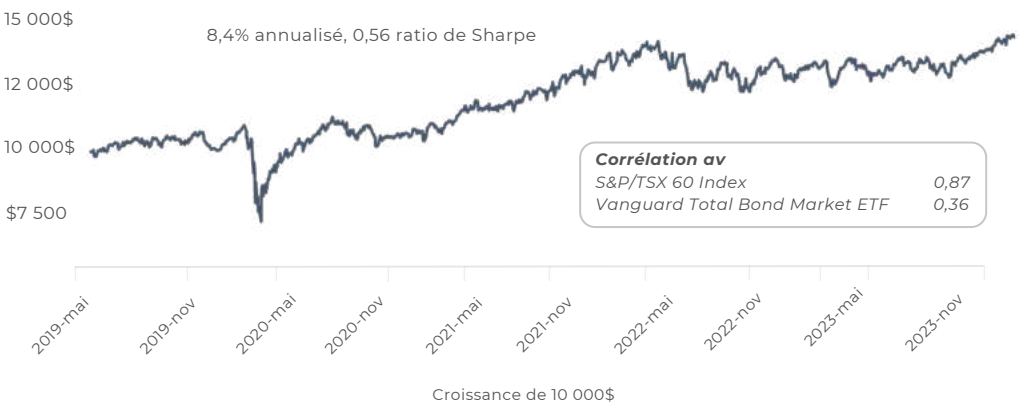
Retours mensuels

	janv	févr	mars	avril	mai	juin	juil	août	sept	oct	nov	déc	Cumul de l'année
2024	3,4%	1,3%											4,7%
2023	4,2%	-0,2%	-2,5%	4,9%	-6,9%	5,2%	2,9%	-1,9%	-1,5%	-2,3%	5,2%	2,9%	9,4%
2022	0,0%	0,6%	3,9%	-2,3%	-0,2%	-9,0%	4,7%	-0,9%	-5,7%	8,2%	3,1%	-6,1%	-5,0%
2021	-1,4%	3,4%	4,4%	3,6%	0,1%	1,5%	0,9%	2,7%	1,1%	3,2%	-1,3%	7,3%	28,3%
2020	3,6%	-2,8%	-13,4%	9,7%	7,5%	2,4%	4,5%	-1,3%	-1,6%	-5,0%	3,3%	0,4%	5,2%
2019					0,7%	1,2%	2,6%	0,7%	0,0%	-1,0%	2,7%	-6,2%	0,5%

Caractéristiques	Acheteur	Vendeur
Nombre de titres	45	45
Capitalisation boursière moyenne (millions)	16 923$	6 587$
Beta	1,0	1,2
VE/EBITDA	10,8%	6,2%
EV/FTD	4,7%	-2,1%
Rendement sur 12 mois	27,0%	-15,6%
% sommet des 52 dernières semaines	94,1%	70,4%
Rendement du capital investi	14,5%	1,7%
Bénéfices bruts/Actifs	7,7%	2,3%
Moyenne mobile 50 jrs/ 200 jrs	110,3%	93,9%
Révisions du BPA	-0,5%	-5,1%
Évolution du nombre d'actions	-1,6%	2,2%
Rendement anormal	3,4%	-3,0%

Croissance des investissements

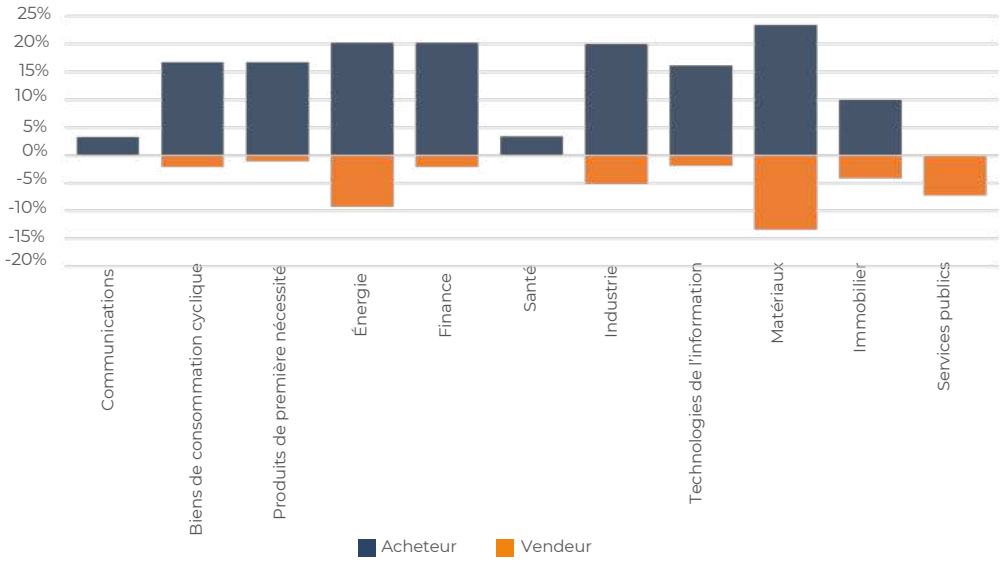
Période: du 10 mai 2019 Au 29 février 2024



10 titres principaux du portefeuille acheteur	Pondération
Fairfax Financial Holdings Ltd	3,6%
Pason Systems Inc	3,4%
Hammond Power Solutions Inc	3,4%
Major Drilling Group International Inc	3,4%
Imperial Oil Ltd	3,4%
Primo Water Corp	3,4%
CES Energy Solutions Corp	3,4%
Spin Master Corp	3,4%
SilverCrest Metals Inc	3,4%
Colliers International Group Inc	3,4%

10 titres principaux du portefeuille vendeur	Pondération
TELUS International CDA Inc	-1,1%
Ballard Power Systems Inc	-1,0%
Superior Plus Corp	-1,0%
Saputo Inc	-1,0%
Ovintiv Inc	-1,0%
Enbridge Inc	-1,0%
Allied Properties Real Estate	-1,0%
Tamarack Valley Energy Ltd	-1,0%
Brookfield Infrastructure Part	-1,0%
Laurentian Bank of Canada	-1,0%

Pondèrations superposèe



DÉNI DE RESPONSABILITÉ: Le rendement antérieur ne reflète pas un rendement futur. Des frais de négociation et de rémunération au rendement estimés ont été déduits des résultats indiqués. Les placements comportent un niveau de risque variable et aucune garantie de profit ne peut être offerte à l'égard du rendement futur de toute stratégie d'investissement. Ce document ne constitue pas des conseils en matière de placement. Pour une liste complète des valeurs mobilières, veuillez consulter www.AccelerateShares.com.