FONDS ALPHA DE CAPITAL-INVESTISSEMENT ACCELERATE

Accelerate

TSX ALFA

FAITS EN BREF

Type:
Réplication de capital-Investissement

Structure:
FNB alternatif

Date de création:
10 mai 2019

Frais de gestion:
0,00%

Prime de performance:
15 % de l'excédent sur le seuil de performance

Gestionnaire:
Accelerate Financial Technologies Inc.

Fréquence des distributions:
None

Bourse:
TSX

Devise:
CAD

Cote de risque:
Moyen/élevé

Au février 26, 2021

Valeur liquidative:
$19,18

À propos du fonds

Le Fonds alpha de capital-investissement Accelerate (TSX : ALFA) cherche à reproduire les rendements des fonds de capital-investissement par l'entremise d'un portefeuille diversifié de positions acheteur-vendeur de titres de capitaux propres et de produits dérivés.

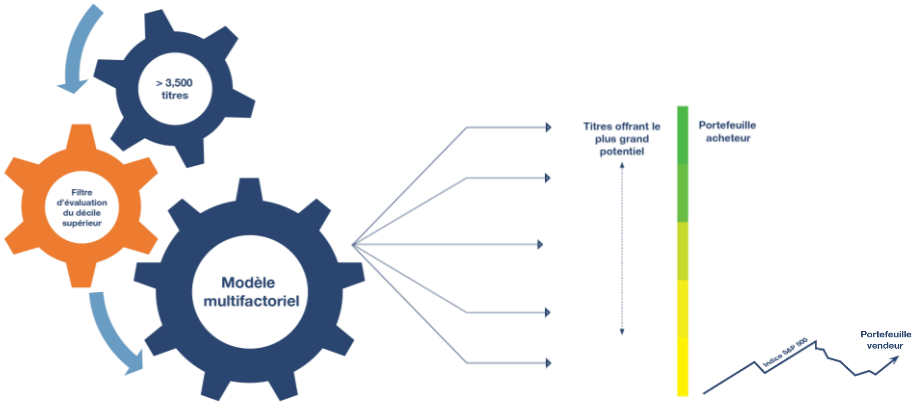
Objectifs des placements

- Reproduire les rendements des fonds de capital-investissement
- Rendement cible de 12 % à 18 %, annualisé
- Conserver les positions acheteur à effet de levier
- Couvrir les positions vendeur à effet de levier
- Offrir des rendements non corrélés

Modèle de placement

ALFA se sert d'un modèle multifactoriel systématique exclusif en deux étapes pour trier et catégoriser les titres nord-américains en fonction de caractéristiques typiques de l'acquisition par emprunt. ALFA filtre en premier lieu les titres nord-américains en fonction de l'évaluation, de la liquidité et de la taille et sélectionne un panier de titres du décile supérieur. ALFA catégorise ensuite ces titres de sociétés à faible et moyenne capitalisation en fonction de quatre facteurs principaux:

- Rendement du capital investi
- Remboursement de la dette
- Bénéfices bruts/Actifs
- Évolution des actifs



Le fonds adopte une position acheteur à l'égard des titres du portefeuille à effet de levier offrant le plus grand potentiel (décile supérieur du modèle multifactoriel), tout en adoptant une position de couverture, en vendant des titres d'un indice portant sur le marché boursier américain dans son ensemble. Le portefeuille est rééquilibré sur une base mensuelle.

info@acceleratеshares.com
www.acceleratеshares.com
1-855-892-0740

FONDS ALPHA DE CAPITAL-INVESTISSEMENT ACCELERATE

TSX ALFA

Caractéristiques

Au février 26, 2021	Acheteur	Vendeur
Nombre de titres	44	1
Capitalisation boursière moyenne (millions)	$1 637	$65 992
Beta	1,1	1,0
VE/EBITDA	13,3%	5,9%
Bénéfices bruts/Actifs	9,6%	6,7%
Évolution de la dette	-21,6%	5,8%
Rendement du capital investi	12,0%	16,4%
Évolution des actifs	-1,6%	5,0%

20 titres principaux du portefeuille vendeur	Pondération
AMC Networks Inc	5,0%
Teradata Corp	4,3%
BlueLinx Holdings Inc	3,8%
Lands End Inc	3,7%
Lakeland Industries Inc	3,6%
Donnelley Financial Solutions	3,6%
Deluxe Corp	3,5%
Avid Technology Inc	3,4%
MarineMax Inc	3,3%
Tribune Publishing Co	3,3%
ODP Corp/The	3,3%
Diebold Nixdorf Inc	3,2%
MSG Networks Inc	3,2%
Apogee Enterprises Inc	3,1%
Mueller Industries Inc	3,0%
Teekay Corp	3,0%
Tivity Health Inc	2,9%
GrafTech International Ltd	2,7%
Crawford & Co	2,7%
NETGEAR Inc	2,7%

Titres du portefeuille vendeur	Pondération
S&P 500 Index Futures	-25,2%

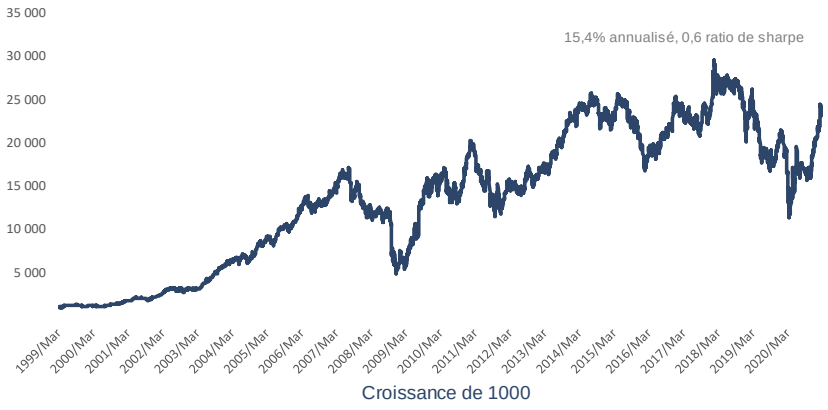
Veuiller visitez le site www.AccelerateShares.com pour obtenir la liste complète des titres

Rendement au février 26, 2021

	1 mois	3 mois	Cumul de l'année	1 an	3 ans	Depuis la création
Valeur liquidative	7,3%	26,0%	18,2%	15,8%	n/a	-6,0%

Fonds alpha de capital-investissement Accelerate

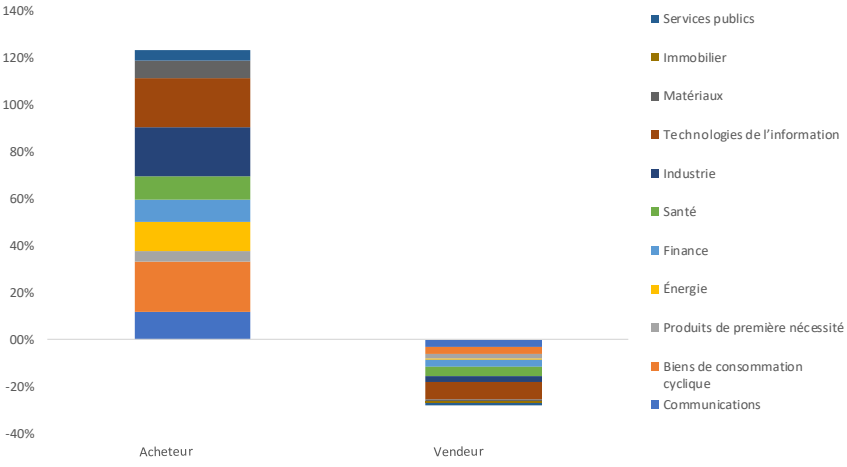
Rendement de référence du portefeuille



DÉNI DE RESPONSABILITÉ : Les résultats du portefeuille de référence du Fonds alternatif d'indicateurs canadiens améliorés Accelerate sont hypothétiques et ne reflètent pas le rendement des placements d'investisseurs donnés. Le rendement antérieur ne reflète également 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.

Pondération sectorielle

Au février 26, 2021



info@acceleratеshares.com
www.acceleratеshares.com
1-855-892-0740