

Cette fiche d'information doit être lue conjointement à notre Notice d'Offre Confidentielle la plus récente. Cette fiche d'information n'est présentée qu'à titre informatif et ne constitue pas ni ne doit être considérée comme une offre de vente ou une sollicitation d'achat des catégories d'unités qui y sont mentionnées. Bien que tous les efforts aient été déployés afin d'assurer la justesse et la fiabilité des données, opinions et analyses, aucune garantie n'est émise quant à l'exactitude et à l'entière de celles-ci. Les rendements passés ne sont pas garants du futur.

RENDEMENT TOTAL | STRATÉGIE QUANTITATIVE « LONG/SHORT »

STRATÉGIE D'INVESTISSEMENT

Notre approche d'investissement combine des stratégies quantitatives, systématiques et d'intelligence artificielle. Chaque jour, nos systèmes analysent plus d'un million de stratégies d'actions et de devises mondiales. Seules les stratégies les plus cohérentes survivent.

OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT

La stratégie d'investissement de Lakeroad vise à maximiser le rendement pour les investisseurs, tout en maintenant une corrélation faible avec les indices d'actions.

RENDEMENTS MENSUELS¹

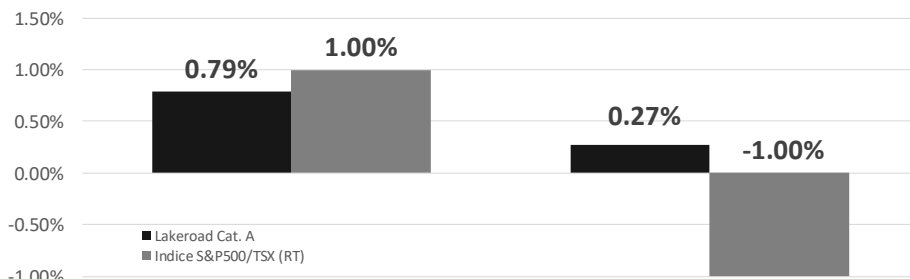
Rendement annualisé de 16.1 % (net de frais)

	J	F	M	A	M	J	JL	A	S	O	N	D	Total
2018	0.6	-3.2	-1.8	0.9	3.7								-0.1
2017	0.1	4.2	-1.4	0.3	1.4	-0.8	0.8	1.6	5.5	2.6	2.3	1.2	19.0
2016	-5.1	0.9	0.3	-11.6	2.4	-1.9	5.1	-2.2	0.1	-0.1	2.8	1.9	-8.1
2015	-1.5	2.2	1.5	-6.5	5.2	-2.9	8.2	-3.4	2.2	3.7	0.9	3.7	13.3
2014	-9.1	7.3	3.2	-0.2	-1.5	-1.1	4.1	2.1	3.0	6.0	5.2	-0.7	18.4
2013	10.1	-0.1	-2.1	5.1	1.7	5.3	3.2	-1.7	9.0	9.9	7.8	-3.3	53.4
2012	4.6	3.8	7.3	1.3	0.4	-1.7	-5.5	3.1	0.0	-1.6	1.1	2.8	16.0

DÉTAILS DU FONDS

Investisseurs	Qualifiés
Investissements	Actions US et CAN
Création	Janvier 2012
Séries	"A", "FA"
Exposition brute	Max 300 %, Min 0%
Exposition nette	Max 150%, Min -50%
Gardien de valeurs	BMO Capital Markets
Administrateurs	Apex Fund Services
Auditeurs	EY Canada
Conseillers légaux	Norton Rose Fulbright
Honoraire de gestion	2%
Partage de profit	20%
Seuil du partage	7%
Rachat	Liquidité Mensuelle

RENDEMENT (MARCHÉS HAUSSIERS vs. BAISSIERS)^{1,2}



Depuis la création de Lakeroad, lorsque son indice de référence baisse de 1 %, Lakeroad augmente en moyenne de 0.27 %.

Au cours des 77 mois depuis sa création, l'indice a reculé 21 fois pour un total -45.7 %. Durant ces mêmes mois, Lakeroad a connu 11 mois positifs pour un total de 12.5 %.

La corrélation actuelle étant très faible (0.26), Lakeroad représente une manière efficace de diversifier un portefeuille.

MESURES DE RISQUES^{1,2}

	LAKEROAD	BENCHMARK
Rendement mensuel moyen	1.33%	0.89%
Rendement cumulatif net	160.9%	93.7%
Rendement annualisé net	16.1%	10.8%
Rendement mensuel moyen - marchés haussiers	1.6%	2.0%
Rendement mensuel moyen - marchés baissiers	0.6%	-2.2%
Pire rendement mensuel	-11.6%	-6.1%
Pire perte cumulée	-15.1%	-8.8%
Écart-type des rendements à la baisse	7.1%	4.4%
Ratio "Sortino"	2.12x	2.22x
Corrélation	0.26	1.00
Béta	0.42	1.00
Béta - marchés à la hausse	0.79	1.00
Béta - marchés à la baisse	0.38	1.00
Ratio "Jensen's alpha"	10.6%	0.0%



JONATHAN LEHOUX

jlehoux@lakeroad.ca | 418-997-3397

PIERRE LAPOINTE

plapointe@lakeroad.ca | 514-503-3575

ALEXANDRE TETU

atetu@lakeroad.ca | 418-208-5023

300 rue Saint-Paul, suite 220
 Quebec (QC) G1K 7R1