

**CARACTÉRISTIQUES**

Région:	ÉU & Global
Processus:	Top - Down
Méthode:	Quantitative
Stratégie:	Macro + Technique
Devise:	Dollar US
Inception:	Janvier 2007
Rebalancement:	Hebdomadaire
Instruments:	Actions & FNB
Effet levier:	Levier: jusqu'à 30%
Biais de placement:	Long seulement
Biais de marché:	Pas de biais
Biais de sect./style:	Pas de biais
Couverture devise:	Aucune
Indice de référence:	S&P 500 TR

**PERFORMANCE**

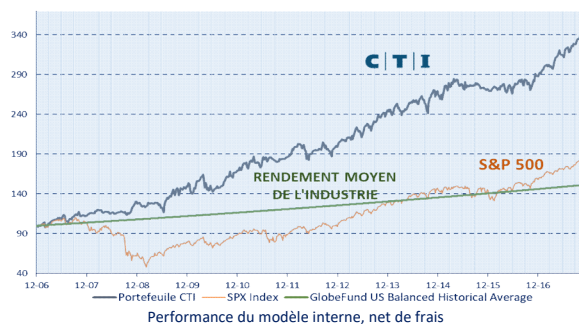
	T1	T2	T3	T4	Annuel
2017	6.0%	4.8%	5.0%	5.4%	19.8%
2016 <sup>(i)</sup>	-0.3%	-2.7%	8.1%	2.1%	7.1%
2015 <sup>(i)</sup>	2.4%	1.1%	-0.5%	-1.5%	1.6%
2014 <sup>(i)</sup>	0.6%	5.0%	0.3%	6.0%	12.3%
2013 <sup>(i)</sup>	6.7%	2.2%	8.3%	8.6%	28.1%

(i) = rendement modèle interne

**STATISTIQUES MENSUELLES**

	Pf	vs.	SPX
% Trimestres Positifs	76.74%		67.44%
% Trimestres Négatifs	23.26%		32.56%
Moy. Rend. Tri. Positifs	5.12%		6.15%
Moy. Rend. Tri. Négatifs	-3.05%		-6.79%
Ratio Sharpe	108.62%		0.30
Beta du portefeuille	59.23%		1.00
Correlation avec l'indice	-5.78%		1.00
Baisse mensuelle max.	-13.10%		-55.91%
VaR 5% sur Rend. Mensuels	-2.74%		0

**GRAPHIQUE HISTORIQUE**



**À QUI CE FONDS S'ADRESSE-T-IL?**

Considérez ce portefeuille si vous cherchez une appréciation à long terme de votre capital en plus d'une diversification par l'usage de multistratégies sur le marché ÉU & Global.

**PROFIL DE RISQUE**



**OBJECTIFS**

Les objectifs primaires du portefeuille sont la:

1. Préservation du capital
2. Performance absolue
3. Minimisation du risque

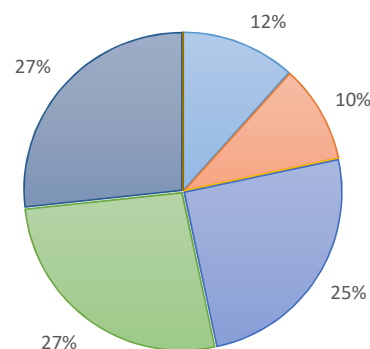
**LE FONDS INVESTI DANS QUELS TITRES?**

Le portefeuille est géré activement et investi dans des fonds négociés à la bourse couvrant divers classes d'actifs, pays et secteurs US.

**STRATÉGIE**

Le portefeuille investi de manière opportunistique dans des stratégies macro, momentum, de gestion de risque, de bonne valeur et d'autres stratégies.

**RÉPARTITION SECTORIELLE**



- USA Stock Market
- Europe
- Asie
- Commodité
- Petite Cap.
- Oblig. Internationales
- Émergents
- Technologie
- Oblig. à LT
- Oblig. À CT

(au 29 Décembre 2017)

**ADRESSE**

1 Place Ville Marie, # 1050  
Montréal, Québec  
H3B 4S6, Canada

**CONTACT**

1.514.861.3500 (téléphone)  
1.800.668.3500 (appel sans frais)  
1.514.861.3230 (fax)  
www.cticap.ca (site web)

**ÉQUIPE**

Viet Buu CFA, MBA  
Gestionnaire principal de portefeuille  
vbuu@cticap.com

Stephan Buu CIM, MBA  
Gestionnaire de portefeuille  
sbuu@cticap.com

Relation aux investisseurs :  
mchad@cticap.com  
sophiebuu@cticap.com

**TERMES**

Investissement minimal	25,000\$ CAD
Investissement additionnel	1000\$ CAD
Éligibilité	Canadiens
Distribution	Aucune
Année fiscale	31 Décembre
Ratio Sharpe	1.11
Beta du portefeuille	0.59
Correlation avec l'indice	0.44
Baisse mensuelle max.	-13.11%

**ÉLIGIBILITÉ**

RÉER	Oui
CELI	Oui
CELI	Oui

**FRAIS DE GESTION**

25K\$ et plus	1.25%
Taux minimal	Aucun
Seuil de rentabilité	Aucun
Frais de rachat	Aucun

**STRUCTURE**

Administration	Interne
Avis légaux	Interne
Gardien de valeurs	NBCN
Courtier primaire	NBCN
Comptabilité	NBCN

**MISSION**

CTI est un courtier en valeurs mobilières de plein exercice dont la mission est d'offrir des services d'exécution et de recherche servant à la réalisation de performances élevées, par nos conseils fondés sur notre expertise et expérience diversifiée, pour notre clientèle composée d'investisseurs institutionnels et privés, d'entreprises et d'agences gouvernementales.

**À PROPOS DE CTI**

CTI a été fondée en 1987 dans un contexte d'évolution rapide des marchés financiers, au début de la période de réorganisation de l'industrie financière au Canada, en particulier pour les courtiers en valeurs mobilières. CTI est une firme indépendante et sa taille relative lui procure une grande flexibilité d'opération tout en assurant l'objectivité et l'impartialité de ses conseils.

**NOTICE LÉGALE**

Ce document ne doit pas être considéré comme une notice d'offre de valeurs mobilières dans aucune juridiction canadienne. Ce document ne fournit que le sommaire des caractéristiques principales du fonds CTI ePortefeuille US Global. Le fonds n'est disponible que pour les investisseurs accrédités ou autres investisseurs respectant les balises définies par l'article 45-106 sur les valeurs mobilières nationales. Le rendement passé n'est pas garant du rendement futur. Pour toute autre information, n'hésitez pas à nous contacter.