

Fonds distinct de titres à revenu fixe de base Plus Gestion SLC

Le fonds cherche à procurer un rendement global axé sur le revenu et la protection du capital à moyen terme, en investissant principalement dans un portefeuille diversifié de placements à revenu fixe publics. Le fonds peut recourir à des placements hypothécaires commerciaux canadiens et/ou à des placements privés et publics à revenu fixe mondiaux de première qualité afin de générer un revenu et un rendement supplémentaires.

Points saillants du fonds

	Fonds	Indice de référence
Rendement à l'échéance	4,56 %	3,91 %
Duration effective	7,33 ans	7,43 ans
Cote de crédit moyenne	A	AA
Valeur liquidative	8,8 M\$	

Actif géré des fonds mis en commun sous-jacents

Fonds de titres à revenu fixe de base Gestion SLC	180 M\$
Fonds de placements privés à revenu fixe Plus Gestion SLC	2 971 M\$
Fonds de placements hypothécaires commerciaux canadiens Gestion SLC	526 M\$

*Fonds Complément seulement

Points saillants de la stratégie

- Portefeuille à durée moyenne de première qualité² qui investit uniquement dans des fonds mis en commun de Gestion SLC
- Les actifs de première qualité peuvent réduire la volatilité par rapport aux stratégies de base Plus traditionnelles.
- Diversification plus poussée grâce à une gamme de possibilités plus étendue, par le recours à nos plateformes mondiales d'analyse des titres de créance publics et privés et des prêts hypothécaires commerciaux.

Rendement du fonds⁴

	T2 2022	CUM (%)	1 an (%)	3 ans (%)	Depuis la date de création
Fonds de titres à revenu fixe de base Plus Sun Life	-5,32	-11,97	-10,67	-1,07	1,16
Indice de référence	-5,66	-12,23	-11,39	-2,30	0,07
Écart	0,34	0,26	0,72	01,22	1,09

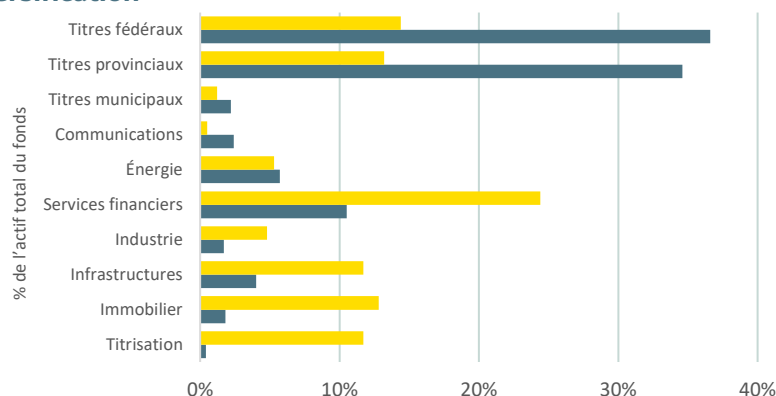
* Fonds lancé le November 30, 2017

Profil du fonds

Répartition actuelle⁵

Placements publics à revenu fixe	80,5 %
Prêts hypothécaires commerciaux	9,9 %
Placements privés à revenu fixe	8,0 %
Liquidités	1,6 %
Placements publics à revenu fixe par pays	
Titres à revenu fixe canadiens	77,5%
Titres à revenu fixe américains	20,0%
Titres à revenu fixe internationaux	1,0%
Liquidités	1,6%

Diversification



*Les prêts hypothécaires sont classés à titre de placements immobiliers dans la composition par secteur.

● Fonds de titres à revenu fixe de base Plus Gestion SLC
● Indice des obligations universelles FTSE[®] Canada

Les **actifs privés de première qualité** des fonds de base Plus Gestion SLC peuvent être **moins fortement corrélés aux actions** que les titres à rendement élevé et les titres de créance des marchés émergents que l'on retrouve habituellement dans les volets « Plus » d'autres fonds.

	Titres américains à rendement élevé	Titres mondiaux à rendement élevé	Titres de créance de marchés émergents	Placements privés à revenu fixe	Prêts hypothécaires commerciaux
Actions canadiennes	0,88	0,81	0,55	0,40	0,27
Actions américaines	0,81	0,78	0,48	0,33	0,23
Actions internationales	0,84	0,87	0,58	0,31	0,19

Les corrélations sont établies pour une période de 10 ans se terminant le 31 dec 2021.

Résumé des directives de placement⁵

Type d'actif	Pourcentage de l'actif net du fonds
Placements publics à revenu fixe	De 80 % à 100 %
Titres à revenu fixe de sociétés	Jusqu'à 70 %
Titres étrangers publics et privés à revenu fixe	Jusqu'à 30%
Actif privé	De 0 % à 20 %*
Liquidités ou titres du marché monétaire	De 0 % à 10 %**

*Au moment de l'achat des titres du ou des fonds privés Gestion SLC par le fonds. Le pourcentage maximal pouvant être investi globalement dans des fonds privés de Gestion SLC qui ne sont pas évalués quotidiennement est de 10 %.

**Le fonds peut détenir des liquidités ou des titres du marché monétaire en excédent de la limite de 10 % afin de s'adapter aux rentrées et aux sorties de capitaux, de financer les paiements versés aux investisseurs, ou à d'autres fins.

Gestionnaires de portefeuille

Douglas J. Gardiner, CFA
Gestionnaire de portefeuille et responsable des titres à revenu fixe, émissions publiques
Années auprès de la société : 21
Années d'expérience dans l'industrie : 31

Randall Malcolm, M.Sc. (finance), CFA
Directeur général principal et gestionnaire de portefeuille, titres à revenu fixe, émissions publiques, Canada
Années auprès de la société : 9
Années d'expérience dans l'industrie : 29

Contactez-nous | gestionslc.com

Andrew Post, CFA
Directeur général,
développement des affaires
Andrew.Post@slcmanagement.com
T : 416-408-8514 | M : 416-460-2795

Catherine Jackman, CFA
Directrice générale,
développement des affaires
Catherine.Jackman@slcmanagement.com
T: 416-408-8729 | M: 437-997-5539

Véronique Lauzière, CFA
Directrice générale,
développement des affaires
Veronique.Lauziere@slcmanagement.com
T: 514-904-9694 | M: 438-342-1226

¹ « FTSE® » est une marque de commerce de FTSE International Limited utilisée sous licence.

² Les cotes de crédit de notre portefeuille de placements privés sont établies en fonction d'une méthode de calcul exclusive élaborée au moyen de modèles achetés à l'externe et d'autres conçus à l'interne. Cette méthode est régulièrement examinée. Plus de précisions seront offertes sur demande. Rien ne garantit que les actifs en portefeuille obtiendraient les mêmes cotes s'ils étaient notés de façon indépendante par de grandes sociétés d'évaluation du crédit.

³ Les cotes présentées comprennent les cotes de crédit supérieures et inférieures d'un niveau selon la classification alphabétique et sont déterminées au moyen d'un processus interne d'évaluation du crédit. Pour connaître ce dernier, veuillez vous reporter à la notice d'offre du fonds, fournie sur demande.

⁴ Les rendements sont indiqués après déduction des frais du fonds et avant déduction des frais de gestion. Les frais de gestion payés directement à la Sun Life du Canada, compagnie d'assurance-vie doivent être pris en compte dans l'évaluation du rendement net. Les rendements pour les périodes supérieures à un an sont annualisés.

⁵ La composition de l'actif repose sur les sommes engagées (actif engagé, mais pas encore provisionné). Les liquidités comprennent d'autres éléments d'actif net comme les sommes à verser et à recevoir.

⁷ Vous trouverez de plus amples renseignements sur les directives de placement du fonds et les risques connexes dans la notice d'offre des fonds sous-jacents, fournie sur demande.

GESTION DE CAPITAL SUN LIFE (CANADA) INC. (Également désigné sous le nom de SLC Revenu Fixe) offre des fonds mis en commun, des comptes à gestion distincte et des services-conseils en matière de placements en valeurs mobilières. Le Fonds de titres à revenu fixe de base Plus Gestion SLC est un fonds distinct offert par la Sun Life du Canada, compagnie d'assurance-vie (la Sun Life) et pour lequel Gestion de capital Sun Life (Canada) inc. agit à titre de sous-conseiller. Les cotisations affectées au fonds distinct sont accumulées en vertu d'un contrat de rente collective émis par la Sun Life. L'actif détenu dans les fonds distincts appartient à la Sun Life.

RENSEIGNEMENTS IMPORTANTS :

La présente fiche de renseignements est préparée à titre informatif et destinée uniquement aux investisseurs institutionnels canadiens. Les renseignements contenus dans le présent document ne doivent en aucun cas tenir lieu de conseils particuliers d'ordre financier, fiscal, juridique ou comptable ni en matière d'assurance ou de placement. Ils ne doivent pas être considérés comme une source d'information à cet égard et ne constituent pas une offre d'achat ou de vente de valeurs mobilières, ni de services d'assurance ou de placement. Les investisseurs devraient obtenir l'avis d'un conseiller professionnel avant de prendre une décision en fonction des renseignements qui figurent dans le présent document.

Tous les montants sont en dollars canadiens, à moins d'indication contraire. Des efforts ont été faits pour veiller à ce que les renseignements du présent document soient fiables et exacts au moment de la publication. Toutefois, Gestion de capital Sun Life (Canada) inc. ne peut pas en garantir l'exhaustivité ni l'exhaustivité.

Les corrélations sont calculées à partir des rendements trimestriels non couverts sur une période de 10 ans se terminant le 31 dec 2021. Le chiffre des placements privés à revenu fixe canadiens représente les rendements des placements du fonds général de la Sun Life dans des prêts privés à revenu fixe d'une durée inférieure à 10 ans, à l'exclusion des baux. Le chiffre des prêts hypothécaires commerciaux canadiens représente le rendement des placements du fonds général de la Sun Life dans des prêts hypothécaires commerciaux non assurés par la SCHL. Le chiffre des actions canadiennes représente le rendement en dollars CA de l'indice composé S&P/TSX. Le chiffre des actions américaines représente le rendement en dollars US de l'indice S&P 500. Le chiffre des actions internationales représente le rendement en dollars US de l'indice MSCI EAO. Le chiffre des titres à rendement élevé américains représente le rendement en dollars US de l'indice BofA Merrill Lynch des obligations à rendement élevé américaines Master II. Le chiffre des titres de créance des marchés émergents représente le rendement en dollars américains de l'indice J.P. Morgan EMBI Plus.

et Gestion de capital Sun Life (Canada) inc. décline toute responsabilité pour quelque perte que ce soit découlant de l'utilisation de ces renseignements. En cas de divergence entre les renseignements contenus dans le présent document et ceux qui figurent dans les documents juridiques du fonds, les états financiers audités ou les relevés des Clients (collectivement appelés « documents juridiques du fonds »), ce sont les renseignements figurant dans les documents juridiques du fonds sous-jacent qui priment. Rien ne garantit que le Fonds distinct de titres à revenu fixe de base Plus Sun Life produira les rendements attendus. Les rendements antérieurs ne constituent pas une garantie des rendements futurs. Le rendement indiqué correspond au rendement avant déduction des frais de gestion de placements (plus-value du capital et revenu compris) et après déduction des frais de gestion administrative. Il est calculé selon la méthode du taux de rendement moyen pondéré par le temps (moyenne géométrique). Les frais de gestion sont payés directement à la Sun Life du Canada, compagnie d'assurance-vie et devront être pris en compte dans l'évaluation du rendement.

Ce document peut présenter des renseignements ou des énoncés qui tiennent compte d'attentes ou de prévisions liées à des événements futurs. Les énoncés prospectifs sont de nature spéculative et peuvent faire l'objet de risques, d'incertitudes et d'hypothèses qui pourraient différer de façon importante des énoncés. Par conséquent, n'accordez pas de confiance excessive à ces énoncés prospectifs.

Aucune partie de ce document ne peut être i) reproduite ou photocopiée, de quelque façon que ce soit et dans quelque format que ce soit, ni être ii) distribuée à toute personne qui n'est pas un employé, un dirigeant, un directeur ou un agent autorisé du destinataire, sans le consentement écrit préalable de Gestion de capital Sun Life (Canada) inc.

© Gestion SLC, 2022.

Les renseignements fournis sont susceptibles de changer sans préavis.

Écart-type ex-post sur 3 ans

Année	Rendement global avant déduction des frais (%)	Rendement de l'indice des obligations universelles FTSE Canada (%)	Nombre de portefeuilles	Dispersion interne (%)	Indice composé	Indice des obligations universelles FTSE Canada	Actif total de l'indice composé à la fin de la période (millions de \$ CA)	Actif total de la société (millions de \$ CA)
2017	-0,37 %	-0,41 %	1	-	-	-	5	S. O.
2018	2,01 %	1,41 %	1	-	-	-	17	S. O.
2019	8,15 %	6,87 %	2	-	-	-	24	163 000
2020	10,18 %	8,68 %	2	-	4,67	4,24	19	180 869
2021	-1,87 %	-2,54 %	2	-	5,23	4,77	22	188 815
2022 ACJ	-12,12%	-12,23%	2	-	6,16	5,75	20	165 248

Renseignements importants

Gestion SLC (« la société ») est un groupe de gestion d'actifs institutionnels qui comprend Gestion de capital Sun Life (Canada) inc. et Sun Life Capital Management (U.S.) LLC (Également désigné sous le nom de SLC Revenu Fixe). Gestion de capital Sun Life (Canada) inc. (« la société ») est inscrite comme gestionnaire de portefeuille, gestionnaire de fonds de placement et courtier sur le marché dispensé dans l'ensemble des provinces et territoires au Canada. La société est aussi inscrite comme gestionnaire d'opérations sur marchandises en Ontario. Le principal organisme de réglementation est la Commission des valeurs mobilières de l'Ontario (« CVMO »). La société est principalement responsable de gérer les portefeuilles de tiers institutionnels au moyen de fonds qui investissent dans diverses catégories d'actifs et de comptes à gestion distincte pouvant inclure des stratégies d'investissements guidés par le passif. La société Sun Life Capital Management (U.S.) LLC est inscrite comme conseiller en placement auprès de la Securities and Exchange Commission (SEC) des États-Unis, conformément à la Advisers Act of 1940. Elle est également inscrite comme Commodity Trading Advisor (conseiller en opérations sur marchandises) et Commodity Pool Operator (gestionnaire de fonds marché à terme) auprès de la Commodity Futures Trading Commission en vertu du Commodity Exchange Act et est membre de la National Futures Association.

Énoncé de conformité

Gestion SLC affirme qu'elle se conforme aux normes Global Investment Performance Standards (GIPS®) et qu'elle a préparé et présenté le présent rapport conformément à celles-ci. Gestion SLC a fait l'objet d'une vérification indépendante pour la période comprise entre le 1er juillet 2019 et le 31 décembre 2020. Une société qui affirme qu'elle se conforme aux normes GIPS® doit établir des politiques et des procédures pour respecter toutes les exigences applicables en vertu de ces normes. La vérification garantit que les politiques et procédures de la société concernant le fonctionnement des fonds composés et des fonds mis en commun, ainsi que le calcul, la présentation et la distribution du rendement, ont été élaborées conformément aux normes GIPS® et mises en œuvre à l'échelle de la société. L'Indice composé – Stratégie de titres à revenu fixe de base Plus a fait l'objet d'un examen du rendement pour la période comprise entre le 1er juillet 2019 et le 31 décembre 2020. Les rapports de vérification et d'examen du rendement sont accessibles sur demande.

Renseignements sur la société

La société est principalement responsable de gérer les portefeuilles de Clients institutionnels qui investissent dans un large éventail de produits diversifiés, y compris des titres de créances publiques, des titres de créances privées, des prêts hypothécaires et des investissements guidés par le passif. Le barème de frais de la société est le suivant : 0,21 %-0,45 % pour la première tranche d'actif géré de 50 millions de dollars; 0,19 %-0,45 % pour la tranche suivante de 50 millions de dollars; 0,10 %-0,45 % pour la tranche suivante de 100 millions de dollars; 0,05 %-0,45 % pour le solde en excédent de 200 millions de dollars. En outre, les frais peuvent être négociés lorsque les circonstances le justifient.

Caractéristiques de l'indice composé

Les calculs ont commencé le 11 novembre 2017. La date de création de cet indice est le 30 novembre 2019. Les portefeuilles sont principalement constitués de divers titres à revenu fixe publics. Ils visent à dégager un rendement global axé sur le revenu, tout en protégeant le capital à moyen terme. La stratégie peut aussi recourir à des titres à revenu fixe privés, à des titres hypothécaires commerciaux canadiens et/ou à des titres à revenu fixe publics et privés non canadiens de première qualité afin de générer un revenu et un rendement supplémentaires. Elle cherche à procurer une exposition au marché des émissions publiques de titres à revenu fixe et à celui des actifs privés (p. ex. : créances privées et créances hypothécaires commerciales). Pour ce faire, elle peut investir dans le Fonds de placements privés à revenu fixe Plus Gestion SLC, le Fonds de placements privés à revenu fixe Plus à long terme Gestion SLC et/ou le Fonds de placements hypothécaires commerciaux canadiens Gestion SLC. Une liste complète ainsi qu'une description des indices composés de la société sont disponibles sur demande.

Indice de référence

L'indice de référence de la stratégie est l'indice des obligations universelles FTSE Canada. Cet indice complet, transparent et axé sur des règles est conçu pour mesurer le rendement des obligations d'État et de sociétés canadiennes de première qualité à taux fixe qui sont libellées en dollars canadiens.

Méthode de calcul

Les évaluations et le calcul des rendements sont effectués et exprimés en dollars canadiens. Les portefeuilles sont évalués quotidiennement. Les rendements sont calculés tous les mois en fonction de la variation de la valeur liquidative par action. Le rendement de l'indice composé est calculé à partir du rendement pondéré en fonction de l'actif de chacun des portefeuilles inclus dans l'indice. Les rendements sont indiqués avant déduction des frais de gestion de placements et après déduction des frais d'exploitation. La dispersion interne correspond à l'écart-type pondéré en fonction de l'actif des comptes de l'indice de référence composé. Elle est calculée uniquement pour au moins six portefeuilles avec des rendements sur l'année entière. L'écart-type annualisé sur trois ans ne porte pas sur l'indice composé. Il indique la variabilité des rendements de l'indice composé et de l'indice de référence pour la période de 36 mois précédente. Les mesures de risque présentées sont basées sur les rendements avant déduction des frais.

Autres renseignements

Les principes directeurs s'appliquant à l'évaluation des placements, au calcul des rendements et à la préparation des rapports GIPS sont fournis sur demande. Les résultats pour la période allant du 30 novembre 2017 au 30 juin 2019 ont été obtenus pendant que l'équipe de gestion des placements était affiliée à une autre société. L'équipe de gestion des placements gère l'indice composé depuis qu'il a été créé, et le processus de placement n'a pas changé. Le rendement historique est lié au rendement de Gestion SLC. Les rendements antérieurs ne garantissent pas les rendements futurs. GIPS® est une marque déposée du CFA Institute. Le CFA Institute n'appuie pas la présente organisation et n'en fait pas la promotion. Il ne garantit pas non plus l'exactitude ou la qualité du contenu de cette présentation.