

Fonds de superposition d'obligations canadiennes de longue durée Gestion SLC

Le fonds vise à procurer une participation en titres à revenu fixe à long terme du gouvernement égale à trois fois la valeur au comptant du fonds. Pour ce faire, il investit principalement dans des titres à revenu fixe à long terme émis par les gouvernements provinciaux du Canada et a recours à des opérations de mise en pension.

Points saillants de la stratégie

- Le fonds investit principalement dans des obligations provinciales à long terme de grande qualité¹.
- Il peut aider les investisseurs à mettre en place plus facilement un programme de superposition synthétique, car la stratégie de produits dérivés est gérée au sein d'un fonds mis en commun.
- Il vise à réduire le risque par l'appariement de la duration et permet de libérer des actifs tangibles aux fins d'investissement dans d'autres stratégies.
- Il recourt massivement aux opérations de mise en pension et aux dérivés (comme les swaps de taux d'intérêt) pour offrir un placement dont la duration est nettement plus longue qu'en investissant directement dans des titres à revenu fixe provinciaux canadiens.

Points saillants du fonds

Type d'instrument : société en commandite – fonds ouvert

Valeur liquidative : 7,5 M\$

Indice de référence : 3 x indice des obligations provinciales à long terme FTSE® Canada, moins 2 x taux CDOR²

	Fonds	Indice de référence
Rendement à l'échéance	8,86 %	7,80 %
Duration effective	45,64 ans	45,24 ans
Cote de crédit moyenne	AA	AA

Rendement du fonds⁴

	T2 2022	CUM (%)	1 an (%)	3 ans (%)	Depuis la date de création
Fonds de superposition d'obligations de longue durée Gestion SLC	-34,87	-57,07	-54,09	-22,49	-17,33
Indice de référence	-34,83	-56,78	-53,30	-22,38	-17,25
Écart	-0,04	-0,28	-0,78	-0,11	-0,08

* Fonds lancé le April 30, 2019

Profil du fonds

Cote de crédit ³	Fonds	Indice de référence
AA	51,0 %	50,0 %
A	49,0 %	50,0 %

Directives de placement⁵

- Pourcentage maximal de l'actif du fonds pouvant être investi dans les titres d'un même émetteur : 10 %
- Levier cible 3,0 (fourchette permise de 2,0 à 4,0)
- Composition de l'indice de référence : Obligations provinciales (100 %)
- Objectif de rendement : Rendement de l'indice de référence + 25 points de base, calculé sur une période mobile de quatre ans

Pour recevoir une liste comprenant le nom et la description de tous les indices composés de Gestion SLC et/ou une présentation conforme aux normes GIPS, écrivez à l'équipe des ventes institutionnelles à salesinquiries@slcmanagement.com

Gestionnaires de portefeuille

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

Trevor Forbes, M.Sc. (finance), CFA

Gestionnaire de portefeuille et directeur principal

Années auprès de la société : 8 | Années d'expérience dans l'industrie : 19

Brett Pacific, CFA

Directeur général principal, produits dérivés et stratégies quantitatives

Années auprès de la société : 18 | Années d'expérience dans l'industrie : 29

Contactez-nous | gestionslc.com

Andrew Post, CFA

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

Catherine Jackman, CFA

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

Véronique Lauzière, CFA

Directrice générale,
développement des affaires
Veronique.Lauziere@slcmanagement.com
B: 514-904-9694 | C: 438-342-1226

¹ Les placements doivent avoir reçu une note de placement de première qualité selon l'échelle de notation de S&P Global Ratings, Moody's, Fitch ou DBRS.

² « FTSE® » est une marque de commerce de FTSE International Limited utilisée sous licence.

³ Au moment du placement. Vous trouverez de plus amples renseignements à ce sujet dans 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 Gestion de capital Sun Life (Canada) inc. doivent être pris en compte dans l'évaluation du rendement net. Les rendements pour les périodes supérieures à un an sont annualisés.

⁵ Vous trouverez de plus amples renseignements sur les directives de placement du fonds et les risques connexes dans la notice d'offre du fonds, 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. Gestion de capital Sun Life (Canada) inc. est le gestionnaire du Fonds de superposition d'obligations de longue durée Gestion SLC.

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. La souscription de parts du fonds doit être réalisée conformément aux dispositions de la notice d'offre du fonds, du contrat de souscription et de la convention de société en commandite (les « documents juridiques du fonds »), et les parts seront uniquement vendues à des investisseurs admissibles conformément aux lois sur les valeurs mobilières applicables. Les investisseurs devraient lire ces documents et obtenir l'avis d'un conseiller professionnel avant d'investir.

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'exactitude ni l'exhaustivité.

Les renseignements fournis sont susceptibles de changer sans préavis, 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 qui priment.

Rien ne garantit que le fonds atteindra son objectif de placement ou produira les rendements attendus. Les rendements antérieurs ne constituent pas une garantie des rendements futurs. Pour des précisions sur la méthode d'évaluation utilisée, veuillez vous reporter à la notice d'offre du fonds.

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.