



# MAJESTIC

GESTION D'ACTIFS

Majestic Gestion d'Actifs est une firme spécialisée en placements alternatifs. L'entreprise, fondée en 2006, s'est passablement démarquée par sa gestion de portefeuille sur les produits dérivés et contrats à terme gérés. Majestic propose des solutions d'investissement permettant d'améliorer le profil risque-rendement de portefeuilles de placement traditionnels.

Majestic Gestion d'Actifs est une firme inscrite en tant que gestionnaire de fonds d'investissement, gestionnaire de portefeuille et courtier sur le marché dispensé auprès de l'AMF et la CVMO, en tant directeur des placements de produits dérivés auprès de la CVMO, en tant gestionnaire de portefeuille en dérivés auprès de l'AMF, auprès de la Commodity Futures Trading Commission (CFTC) en tant que Commodity Trading Advisor (CTA) et est membre de la National Futures Association (NFA) aux États-Unis.

***Édifice Montréal Board of Trade  
300, St-Sacrement, Bureau 320  
Montréal (Qc) Canada H2Y 1X4  
514-281-4099  
[info@majesticassetmanagement.com](mailto:info@majesticassetmanagement.com)***

Le contenu de ce document ne doit pas être considéré comme un appel public à l'épargne ou comme cherchant à solliciter l'intérêt du public en vue d'un achat de valeurs mobilières dans quelque juridiction que ce soit et notamment, sans que cette liste soit limitative au Canada et aux États-Unis. Les parts de Fonds sont offertes par voie de placement privé, auprès d'investisseurs qualifiés, basé sur une dispense de l'exigence de préparer et déposer un prospectus auprès des autorités en valeurs mobilières. Le risque de perte dans les contrats à terme ou les options sur marchandises peut être important et ne convient pas à tous les investisseurs. Contactez le gestionnaire pour plus d'informations sur ces risques.

## CARACTÉRISTIQUES GÉNÉRALES

Stratégie	Contrats à terme gérés
Début du programme	Février 2005
Actifs de la firme	325M\$

## VÉHICULE D'INVESTISSEMENT

Structure	Fonds en Fiducie
Nom du Fonds	Fonds Majestic Global Diversifié
Avis légaux	Fasken Martineau
Vérificateur	KPMG
Administrateur	SGGG Fund Services
Courtier	Société Générale Capital Canada
Gardien de valeurs	Scotia Capital
Fiduciaire	TSX Trust Company
Code FundServ	MAJ100 / MAJ101 / MAJ102
Classes d'unités	A, F et I (NAV hebdomadaire)
Frais (Classe F)	1/20 (avec HWM)
Éligibilité	REER, CÉLI, FERR, REÉE

## DESCRIPTION DE LA STRATÉGIE

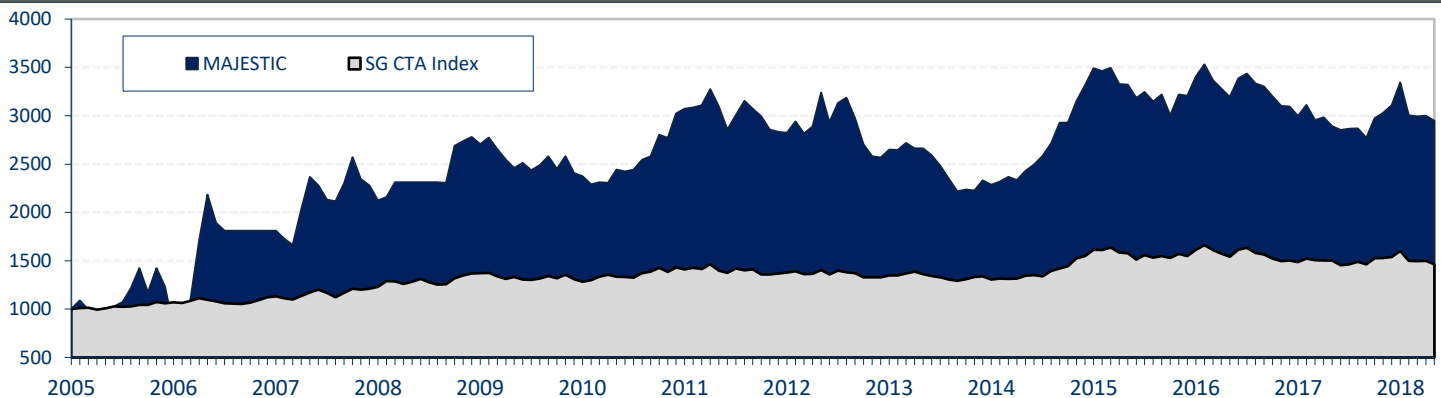
La stratégie d'investissement employée par Majestic a évolué à travers le temps; celle-ci est aujourd'hui plus diversifiée, plus robuste et moins volatile. La stratégie, qui est disponible via le Fonds Majestic Global Diversifié, continue de capitaliser sur les émotions humaines et les irrationalités de marché. Le Fonds utilise une approche multi-stratégies couvrant plusieurs marchés de contrats à terme tels que les grains, métaux, produits énergétiques, bétail, produits tropicaux, devises, indices boursiers et obligations mondiales. L'objectif premier du Fonds est d'offrir un rendement non corrélé aux autres classes d'actifs traditionnelles (actions, obligations et immobiliers). Le Fonds vise à capter les tendances haussières et baissières qui se présentent sur les marchés mondiaux tout en produisant un rendement supérieur et moins volatile que les principaux indices boursiers.

PERFORMANCE CUMULÉE	1 mois	YTD	1 an	5 ans	Total <sup>1</sup>
<b>MAJESTIC</b>	<b>-1.8%</b>	<b>-5.2%</b>	<b>1.8%</b>	<b>10.7%</b>	<b>194.6%</b>
SP500 Index Total Return	2.2%	1.2%	12.2%	78.9%	194.5%
SG CTA Trend-Sub Index	-2.8%	-5.9%	-1.9%	6.7%	61.4%
SG CTA Index	-2.5%	-5.1%	-2.8%	7.3%	46.2%
Altegris 40 Index	0.0%	0.0%	2.3%	9.9%	50.8%

<sup>1</sup> À partir de février 2005.

## MAJESTIC vs SG CTA INDEX

VALEUR DE 1000\$ INVESTIE



## ANALYSE DE PERFORMANCE DEPUIS 02/2005

Les rendements passés ne sont pas indicatifs des rendements futurs.

### ANALYSE DE RENDEMENT

Rendement cumulatif	194.6%
Rendement composé annuel	8.4%
Rendement mensuel moyen	0.7%
Écart-type annuel	21.6%

### ANALYSE DU RISQUE

Meilleure année	47.2%
Pire année	-13.5%
Meilleur rendement sur 12 mois	126.6%
Pire rendement sur 12 mois	-28.9%

### CORRÉLATION <sup>2</sup>

SP500 Index Total Return	-0.01
SG CTA Trend-Sub Index	0.48
SG CTA Index	0.48
Altegris-40 Index	0.44

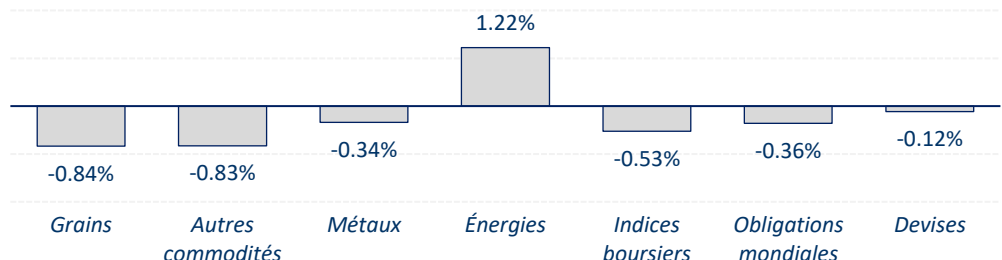
<sup>2</sup> Source: Bloomberg, Barclayhedge.com, Altegris.com

## RENDEMENT MENSUEL PAR SECTEUR

MAI 2018

## ATTRIBUTION DE PERFORMANCE PAR SECTEUR

Grains	-0.84%
Autres commodités	-0.83%
Métaux	-0.34%
Énergies	1.22%
Indices boursiers	-0.53%
Obligations mondiales	-0.36%
Devises	-0.12%
<b>Total</b>	<b>-1.79%</b>



## SOMMAIRE

Depuis février 2005, MAJESTIC surperforme le SG CTA Index et l'Altegris-40 Index par plus de 148% et 143% respectivement.

## MAJESTIC GESTION D'ACTIFS

300, Saint-Sacrement, bureau 320  
Montréal (Qc) Canada H2Y 1X4

Le présent document est publié à titre d'information seulement. Les informations contenues dans ce document ont été obtenues de sources considérées comme étant fiables. Toutefois, Majestic Gestion d'Actifs ne peut donner quelque garantie que ce soit en ce qui concerne l'exactitude et l'intégralité de l'information ou de l'analyse qui y figurent et se dégage de toute responsabilité de quelque nature que ce soit à l'égard de tout préjudice découlant de l'utilisation de ce document ou de son contenu. Les rendements passés ne sont pas nécessairement indicatifs des rendements futurs.<sup>1</sup> La performance affichée du 02/2005 au 03/2008 (inclusivement) provient des comptes gérés par les fondateurs de Majestic Gestion d'Actifs. Les rendements présentés entre 09/2008 et 12/2010 (inclusivement) sont ceux du Fonds de Commodités Palos Majestic S.E.C. géré par Majestic Gestion d'Actifs, et entre 01/2011 et le mois présent (inclusivement) ceux du Fonds Majestic Global Diversifié géré par Majestic Gestion d'Actifs. Les rendements entre 09/2008 et 05/2012 (inclusivement) ont été extrapolés à partir de la valeur liquidative nette de la Classe A des fonds, ajustée en fonction des frais de la Classe F. Les rendements postérieurs au 05/2012 sont ceux de la valeur liquidative nette de la Classe F. Les rendements sont nets des frais de gestion (1%) et de performance (20%).