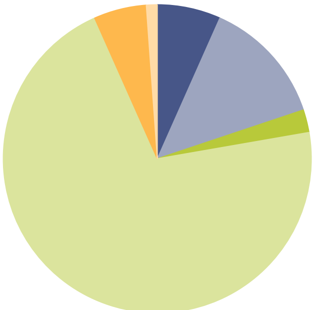
Providence Conservateur

Aperçu du portefeuille

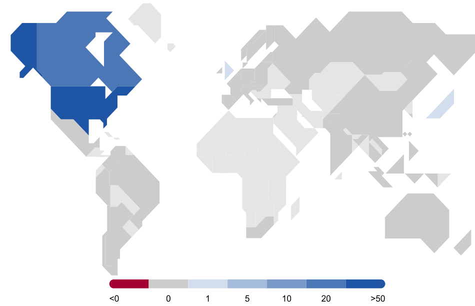
Frais de gestion moyen	Rendement du portefeuille	Date de création	Indice de référence
0.65%	3.38%	4/10/2017	Benchmark - Conservative

Répartition de l'actif



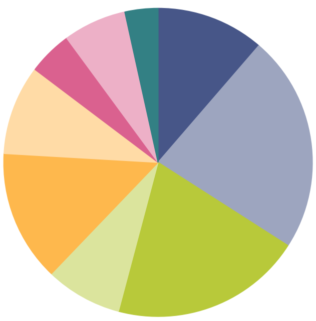
	%
Actions canadiennes	6.7
Actions américaines	13.2
Actions internationales	2.4
Revenu fixe	71.1
Trésorerie	5.5
Autres	1.1

Exposition aux actions par pays



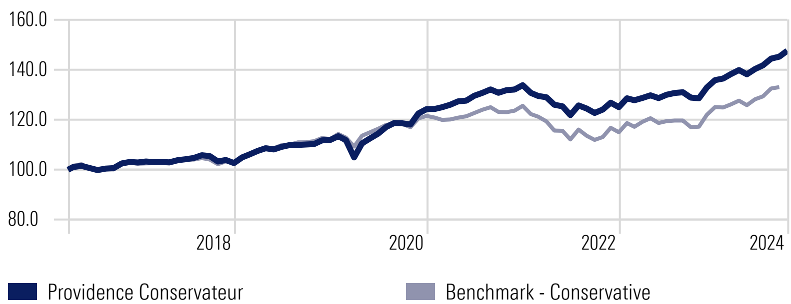
	%
Etats-unis	59.4
Canada	29.9
Royaume-Uni	3.2
Japon	1.4
Suisse	0.9
Danemark	0.9

Style d'investissement en actions



	%
Grande valeur	11.3
Noyau large	22.8
Grande croissance	20.1
Valeur moyenne	8.0
Noyau moyen	13.8
Croissance moyenne	9.4
Petite valeur	4.6
Noyau petit	6.6
Petite croissance	3.5

Performance



Sectorielle des actions

Cyclique	**43.4%**
Matériaux de base	3.1%
Consommation cyclique	10.1%
Services financiers	17.4%
Immobilier	12.8%
Sensible	**40.7%**
Services de communication	5.3%
Énergie	6.8%
Valeurs industrielles	12.9%
Technologie	15.7%
Défensif	**15.9%**
Consommation défensive	3.6%
Soins de la santé	10.5%
Services publics	1.8%

Géographique des actions

Amériques	**90.2%**
Canada	29.9%
Etats-unis	59.4%
Grande Europe	**6.9%**
Danemark	0.9%
France	0.5%
Allemagne	0.2%
Pays-Bas	0.2%
Suisse	0.9%
Royaume-Uni	3.2%
Grande Asie	**2.8%**
Australie	0.5%
Japon	1.4%
Région Emergente	**1.7%**

Rendements annualisés

	Portefeuille	Benchmark
1 Mois	1.6%	—
3 Mois	4.1%	—
6 Mois	5.5%	—
1 an	14.5%	—
3 ans	4.1%	—
5 ans	6.0%	—
10 ans	—	—
Depuis la création	5.2%	—

Rendements par année civile

	Portefeuille	Benchmark
Cumul annuel	8.6%	—
2023	8.6%	8.7%
2022	-6.6%	-8.4%
2021	7.7%	3.3%
2020	11.0%	8.2%
2019	9.0%	9.0%
2018	-0.2%	0.6%
2017	—	4.5%
2016	—	2.7%
2015	—	6.0%

Répartition du revenu fixe

Gouvernement	35.7%
Municipalités	0.0%
Entreprises	42.3%
Titres titrisés	8.0%
Trésorerie et équivalents	5.5%

Statistiques sur le revenu fixe

Durée effective moyenne	5.3
Échéance effective moyenne	7.2
Coupon moyen	3.7%
Qualité du crédit moyenne	BBB

Statistiques de risque et rendement du portefeuille

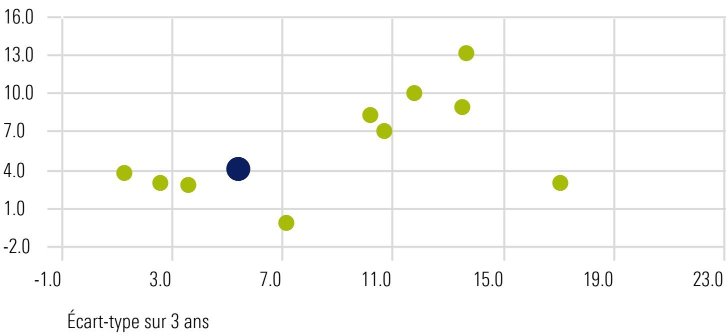
	Écart-type	Capture à la hausse	Capture à la baisse	Perte max.
1 an	4.1%	—	—	-1.2%
3 ans	5.4%	—	—	-8.9%
5 ans	6.1%	—	—	-8.9%

Providence Conservateur

Aperçu du portefeuille

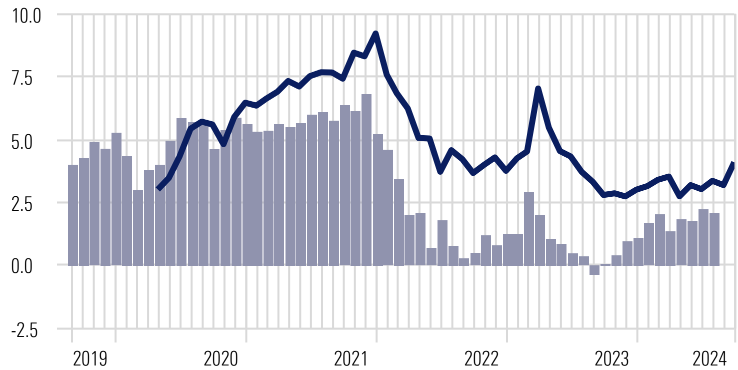
Frais de gestion moyen	Rendement du portefeuille	Date de création	Indice de référence
0.65%	3.38%	4/10/2017	Benchmark - Conservative

Rendement-risque sur 3 ans



Providence Conservateur   Benchmark - Conservative

Rendements glissants sur 3 ans



Analyse fondamentale

Actions	Portefeuille	Benchmark
Taille		
Cap. bours. moy. (M)	$ 81,518	$ 183,333
Multiples de valorisati		
Cours/Valeur comptable	2.9	3.3
Cours/Flux monétaire	14.0	15.3
Cours/Bénéfice	21.5	22.9
Cours/Ventes	2.1	2.4
Ratios financiers		
Marge nette	18.2%	18.8%
RDA	10.1%	12.6%
RCP	24.5%	28.4%
ROIC	18.8%	22.2%

Revenu fixe	Portefeuille	Benchmark
Géographie		
Canada	79.8%	97.7%
États-Unis	15.3%	1.0%
Qualité de crédit		
AAA	33.0%	41.8%
AA	23.2%	32.9%
A	14.9%	14.1%
BBB	15.4%	10.9%
BB	3.5%	0.0%
B	0.8%	0.0%
En dessous de B	1.0%	0.0%
Non noté	8.1%	0.3%

Rendement et risque sur 3 ans

	Portefeuille	Benchmark
Écart-type	5.4%	—
Écart-type perte	2.7%	—
Ratio de Sharpe	-0.20	—
Ratio de Sortino	-0.26	—
Meilleur mois	3.3%	—
Pire mois	-2.8%	—
Perte max.	-8.9%	—

Rendement et risque sur 5 ans

	Portefeuille	Benchmark
Écart-type	6.1%	—
Écart-type perte	4.7%	—
Ratio de Sharpe	0.26	—
Ratio de Sortino	0.36	—
Meilleur mois	5.3%	—
Pire mois	-6.2%	—
Perte max.	-8.9%	—

Titres du portefeuille

Nom	**Pondération**	Cote de risque	Catégorie Morningstar	Frais de gestion	RFG	Rendement
TD indiciel obligations can F	**25.2%**	Bas	Canada - Revenu fixe canadien	0.15%	0.17%	2.04%
Lysander-Canso ttrs crt trm et tx var F	**16.7%**	Bas	Canada - Produits de taux Canadiens de CT	0.55%	0.67%	3.15%
Lysander-Canso valeur d'oblig de soc F	**14.7%**	Bas	Canada - Revenu fixe de sociétés mondiales	0.75%	0.90%	5.01%
Dynamique titres de qual à taux var F	**14.5%**	Bas	Canada - Produits de taux Canadiens de CT	0.30%	0.42%	6.99%
Fonds Select mondial AGF F	**5.2%**	Moyen	Canada - Action mondiale	0.80%	1.15%	0.00%
TD indiciel américain F	**5.2%**	Moyen	Canada - Action américaine	0.15%	0.17%	0.79%
NCM Catégorie de croissance du revenu F	**5.1%**	Moyen	Canada - Actions canadiennes équilibrées	1.00%	1.55%	3.68%
NCM Cat mondiale de croiss du revenu F	**5.0%**	Faible à Moyen	Canada - Actions mondiales équilibrées	1.00%	1.45%	3.49%
Dynamique immobilier mondial série F	**2.8%**	Moyen	Canada - Actions de l'immobilier	1.00%	1.22%	2.13%
Dynamique canadien de dividendes F	**2.1%**	Faible à Moyen	Canada - Dividende et revenu d'Actions Canadiennes	0.85%	1.13%	3.49%
TD US Disciplined Equity Alpha - F	**2.0%**	Moyen	Canada - Action américaine	0.80%	0.88%	0.18%

Providence Conservateur

Statistiques PTM du portefeuille

	Écart-type	Alpha	Bêta	R2	Ratio d'information	Écart de suivi	Mois positifs	Mois négatifs
1 an	4.1%	—	—	—	—	—	10	2
3 ans	5.4%	—	—	—	—	—	22	14
5 ans	6.1%	—	—	—	—	—	41	19
10 ans	—	—	—	—	—	—	—	—

Composition du portefeuille

	Pondération	Cumul annuel	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Depuis la création	Date de création
Providence Conservateur		**8.6**	**14.5**	**4.1**	**6.0**	**—**	**5.2**	**4/10/2017**
Dynamique canadien de dividendes F	**2.1%**	13.2%	21.4%	10.1%	11.7%	9.6%	8.2%	4/5/2002
Dynamique immobilier mondial série F	**2.8%**	14.8%	28.9%	3.1%	4.9%	7.7%	6.2%	1/12/2007
Dynamique titres de qual à taux var F	**14.5%**	4.4%	6.0%	3.8%	2.9%	2.1%	2.2%	9/6/2013
Fonds Select mondial AGF F	**5.2%**	24.9%	34.5%	9.0%	17.4%	16.6%	6.2%	4/27/2000
Lysander-Canso ttrs crt trm et tx var F	**16.7%**	5.7%	9.2%	3.0%	3.6%	2.8%	2.8%	9/18/2013
Lysander-Canso valeur d'oblig de soc F	**14.7%**	5.9%	9.5%	2.9%	8.4%	6.1%	6.7%	12/23/2011
NCM Cat mondiale de croiss du revenu F	**5.0%**	15.4%	25.7%	8.4%	10.3%	9.3%	9.5%	5/31/2011
NCM Catégorie de croissance du revenu F	**5.1%**	15.3%	20.8%	7.1%	10.6%	6.8%	9.0%	12/30/2005
TD indiciel américain F	**5.2%**	24.3%	35.6%	13.2%	16.0%	14.7%	6.7%	11/1/2000
TD indiciel obligations can F	**25.2%**	4.1%	12.4%	-0.2%	0.5%	1.8%	3.9%	11/1/2000
TD US Disciplined Equity Alpha - F	**2.0%**	20.1%	29.1%	14.9%	15.9%	—	14.8%	9/13/2016

Composition de l'indice de référence

	Pondération	Cumul annuel	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Depuis la création	Date de création
Benchmark - Conservative		**—**	**—**	**—**	**—**	**—**	**—**	**12/31/2011**
FTSE Canada d'obligations crt terme	**35.0%**	3.7%	7.5%	1.2%	1.7%	1.8%	6.7%	12/31/1979
FTSE Canada obligataire universel	**40.0%**	2.3%	7.9%	-1.2%	0.1%	2.0%	7.6%	12/31/1979
Morningstar DM xNA NR CAD	**10.0%**	15.4%	24.4%	6.8%	8.4%	7.7%	5.0%	5/1/2015
S&P 500 RT CAD	**10.0%**	25.1%	36.2%	14.3%	16.4%	15.4%	8.8%	1/31/2002
S&P/TSX composé RT CAD	**5.0%**	17.2%	26.7%	9.5%	10.9%	8.2%	9.1%	1/3/1977

Divulgation de l'indice de référence

FTSE Canada Short Term Bond
The index measures the performance of a broadly diversified range of investment grade federal, provincial, municipal and corporate bonds with a term to maturity between one and five years. It is a market capitalization weighted index.

FTSE Canada Universe Bond
The index measures the performance of investment-grade Government of Canada, provincial, corporate and municipal bonds issued domestically in Canada and denominated in Canadian dollars.

Morningstar Developed Markets xNA NR CAD
The Morningstar Developed Markets ex-North America Index measures the performance of large-, mid- and small-cap stocks in developed markets around the world outside of North America, representing the top 97% of the investable universe by market capitalization.

S&P 500 TR CAD
The index measures the performance of 500 widely held stocks in US equity market. Standard and Poor's chooses member companies for the index based on market size, liquidity and industry group representation. It is market capitalization-weighted.

S&P/TSX Composite TR
The S&P/TSX Composite covers approximately 95% of the Canadian equities market, and has been the primary gauge for Canadian-based, Toronto Stock Exchange-listed companies since 1977.

Holdings Proxy
Benchmark constituent composition is calculated using the following proxies: iShares MSCI World Index ETF, iShares Core Canadian Universe Bond Index ETF.

Providence Conservateur

Consolidated Holdings

Indice utilisé pour le calcul : iShares MSCI World ETF   Avoirs en portefeuille au : 9/30/2024   10 premiers avoirs : 17.69%   Autre : 82.31%

	Pondération portefeuille	Symbole	Pays	Secteur	Date du portefeuille	Pondération de l'indice
Markit North American Investment Grade Cdx Index	**6.45%**	**—**	**—**	**—**	**—**	**—**
Dynamique titres de qual à taux var F	6.45%	—	—	—	6/30/2024	—
Canadian Imperial Bank Of Commerce Interest Rate S	**1.75%**	**—**	**—**	**—**	**—**	**—**
Dynamique titres de qual à taux var F	1.75%	—	—	—	6/30/2024	—
Canada (Government of) 0.5%	**1.71%**	**—**	**CAN**	**—**	**—**	**—**
Lysander-Canso valeur d'oblig de soc F	1.45%	—	—	—	7/31/2024	—
TD Canadian Aggregate Bond Index ETF	0.27%	TDB	CAN	—	8/31/2024	—
The Toronto-Dominion Bank 5.49%	**1.31%**	**—**	**CAN**	**—**	**—**	**—**
Dynamique titres de qual à taux var F	1.29%	—	—	—	6/30/2024	—
TD Canadian Aggregate Bond Index ETF	0.02%	TDB	CAN	—	8/31/2024	—
Canada (Government of) 2%	**1.29%**	**—**	**CAN**	**—**	**—**	**—**
Lysander-Canso ttrs crt trm et tx var F	1.12%	—	—	—	7/31/2024	—
TD Canadian Aggregate Bond Index ETF	0.17%	TDB	CAN	—	8/31/2024	—
Toronto-Dominion Bank (The) Interest Rate Swap, Va	**1.23%**	**—**	**—**	**—**	**—**	**—**
Dynamique titres de qual à taux var F	1.23%	—	—	—	6/30/2024	—
Air Canada 4.63%	**1.16%**	**—**	**CAN**	**—**	**—**	**—**
Lysander-Canso ttrs crt trm et tx var F	0.59%	—	—	—	7/31/2024	—
Lysander-Canso valeur d'oblig de soc F	0.57%	—	—	—	7/31/2024	—
Toronto-Dominion Bank (The) Interest Rate Swap, Va	**1.02%**	**—**	**—**	**—**	**—**	**—**
Dynamique titres de qual à taux var F	1.02%	—	—	—	6/30/2024	—
New York Life Global Funding 2%	**0.90%**	**—**	**USA**	**—**	**—**	**—**
Lysander-Canso ttrs crt trm et tx var F	0.90%	—	—	—	7/31/2024	—
NVIDIA Corp	**0.88%**	**NVDA**	**USA**	**Technologie**	**—**	**4.25%**
Fonds Select mondial AGF F	0.41%	—	—	—	8/31/2024	—
TD indiciel américain F	0.21%	—	—	—	6/30/2024	—
TD US Disciplined Equity Alpha - F	0.14%	—	—	—	6/30/2024	—
TD U.S. Equity Index ETF	0.11%	TPU	CAN	—	8/31/2024	—