

LES INDICES DE RISQUE DE PROSPECTUS FUNDATA^{MC}

Les Indices de risque de prospectus Fundata procureront aux institutions, aux gestionnaires de portefeuille, aux conseillers et aux investisseurs un outil puissant de comparaison du rendement et de la volatilité de fonds communs de placement aux perspectives de risque similaires.

Fundata Canada recense 99,9 % des cotes de risque de prospectus actuels de plus de 12 300 fonds à prospectus au Canada.

Selon les recommandations de l'Institut des fonds d'investissement du Canada, l'écart-type est la mesure de risque de portefeuille la plus reconnue et la plus compréhensible et devrait donc être liée à la cote de risque de prospectus attribuée à un fonds. Toutefois, les gestionnaires sont libres d'attribuer à leur fonds la cote de risque qu'ils jugent convenable.

parmi les écarts-types des fonds d'une même catégorie de risque. Les Indices de risque de prospectus Fundata soulèvent ces divergences en établissant des points de référence objectives permettant de déterminer dans quelle mesure un fonds s'écarte ou non de sa catégorie de risque mentionnée.

Les Indices de risque de prospectus Fundata procureront aux investisseurs un repère qui permettra d'évaluer un fonds en fonction du niveau de risque qui lui a été attribué par son gestionnaire.

TÉLÉPHONE :

416.445.5534 poste 260
888.328.9174 poste 260

COURRIEL :

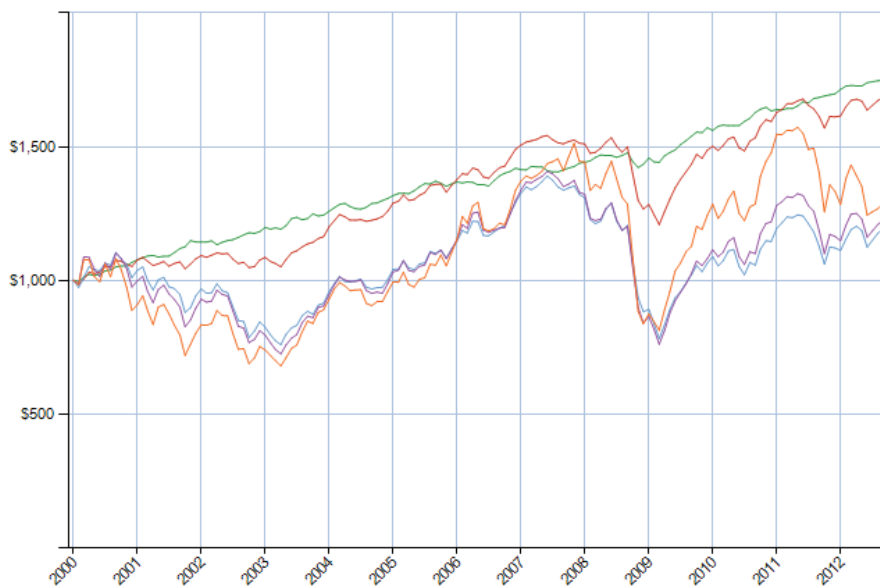
indices@fundata.com

SITE WEB :

fundata.com/fundindices

Cela peut entraîner d'importantes divergences

INDICES DE RISQUE DE PROSPECTUS FUNDATA



■ Risque faible ■ Risque faible à moyen ■ Risque moyen ■ Risque moyen à élevé ■ Risque élevé

RENDEMENT

Rendement simple

Rendement composé

Indices	1 M	3 M	6 M	Cumul annuel	1 A	3 A	5 A	10 A
Indice de risque faible	0.68%	1.44%	2.58%	3.37%	4.60%	4.50%	4.44%	4.19%
Indice de risque faible à moyen	1.51%	3.72%	3.82%	7.43%	7.56%	6.01%	2.61%	5.13%
Indice de risque moyen	2.43%	6.39%	5.38%	12.54%	11.21%	6.61%	-1.56%	4.44%
Indice de risque moyen à élevé	2.99%	7.52%	5.67%	13.23%	10.89%	7.20%	-1.10%	5.25%
Indice de risque élevé	4.90%	11.75%	4.80%	10.34%	4.37%	5.98%	-1.31%	7.16%

MÉTHODOLOGIE

- Un indice équi pondéré qui suit les profils de performance et de risque-rendement des fonds composants.
- Les fonds composants doivent avoir une ancienneté de trois ans ou plus.
- Cinq catégories de classement de risque de prospectus :
 - Risque faible
 - Risque faible à moyen
 - Risque moyen
 - Risque moyen à élevé
 - Risque élevé
- Le même test de fonds composants est utilisé pour chaque indice et les cotes de risque sont mises à jour mensuellement.
- Les fonds de la même catégorie sont représentés sur un graphique qui compare l'écart-type annualisé et le rendement composé sur une période de 3 ans.

Exclusions

Les fonds du marché monétaire sont exclus des Indices en raison du fait qu'il y a très peu de variation de la performance ou de la volatilité dans cette catégorie. Les fonds institutionnels et de série F ont aussi été exclus. Les fonds en dollars américains seront exclus quand ils représentent une option d'achat d'un fonds en dollars canadiens.

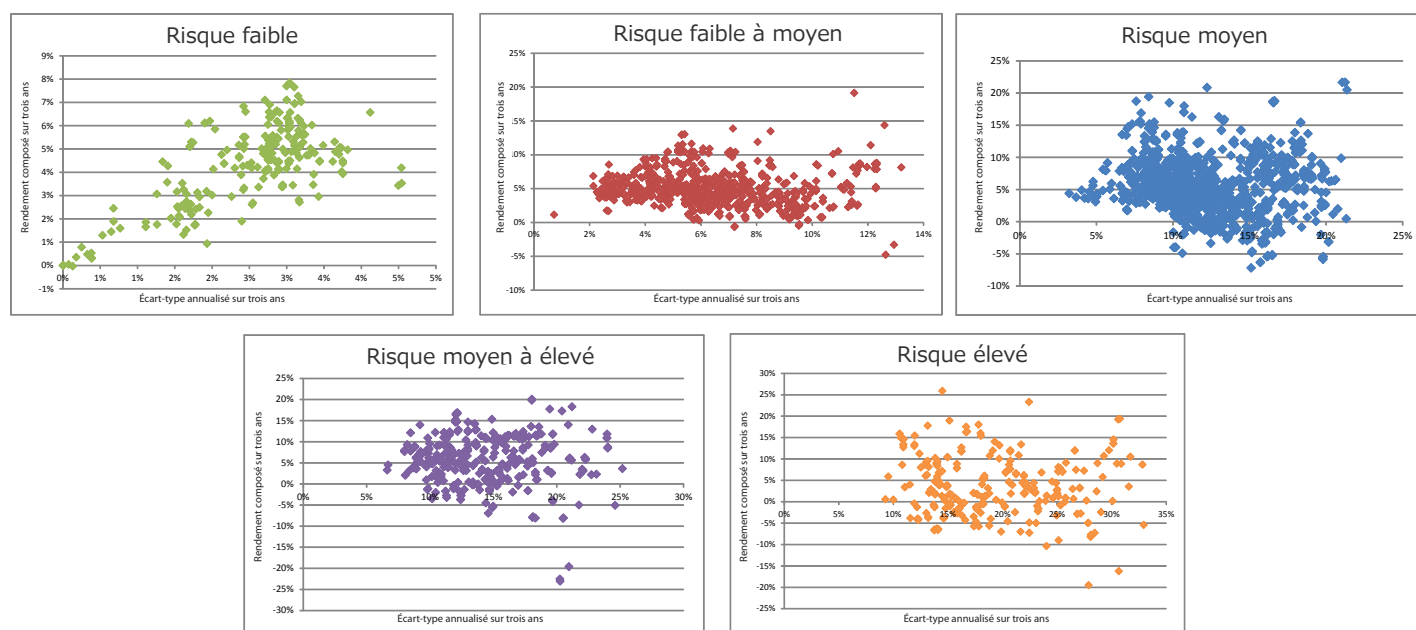
Maintenance

Afin d'assurer l'intégrité des indices, des tests pour déterminer les fonds composants ont lieu chaque mois. La valeur initiale de chaque indice est déterminée et la moyenne des rendements mensuels est appliquée afin d'établir la nouvelle valeur de l'indice. Le biais du survivant est évité grâce à l'inclusion des fonds actifs à la fin de chaque mois depuis le début de l'indice. Ainsi, les données qui se rapportent à des fonds actuellement fermés ou fusionnés seront conservées pour la période où ces fonds ont été actifs.

Valeurs aberrantes

Un test a lieu chaque mois pour identifier les valeurs aberrantes en fonction de l'écart-type sur trois ans et la volatilité relative de chaque catégorie. Les intervalles de variation de volatilité acceptable sont déterminés et les fonds qui se situent en dehors de ces intervalles sont considérés comme étant des valeurs aberrantes.

ÉCART-TYPE COMPARÉ AU RENDEMENT



Avis de non-responsabilité

Les Indices de risque de prospectus (« les Indices ») servent uniquement à titre d'information et ne devraient pas servir de conseils de placement, financiers ou autres, et il ne faut pas se fier à de telles informations pour de tels conseils. Fundata Canada Inc. (« Fundata ») n'est pas un conseiller en placements et l'inclusion d'un fonds dans les Indices ne constitue pas une recommandation par Fundata d'acheter, de vendre ou de détenir des titres détenus par un tel fonds ni ne doit être considérée comme étant un conseil d'investissement.

Dans tout la mesure permise par la loi, Fundata décline toutes les représentations, garanties et conditions, expresses ou tacites, dans le cadre des Indices, y compris, sans s'y limiter, toutes les représentations, les garanties et les conditions quant à l'exactitude, la pertinence, l'exhaustivité, la disponibilité, l'absence d'erreurs ou d'omissions, la qualité ou l'aptitude à une fin particulière. Fundata a créé ces Indices à partir d'informations obtenues de sources qu'elle croit fiables, mais ne fournit aucune représentation ou garantie quant à la l'exactitude ou l'exhaustivité de ces informations. Fundata ne tient pas compte des besoins d'un utilisateur particulier des Indices au moment d'établir ou de calculer les Indices. En aucun cas Fundata ne sera tenu responsable de dommages, de frais ou de pertes de quelque nature que ce soit résultant de tout usage que l'on pourrait faire des Indices même si elle a été avisée de la possibilité de tels dommages.

Les points de vue, opinions et conseils de tierces parties dans le cadre des Indices sont celles des auteurs et ne sont pas endossés par Fundata. Fundata n'a pas préparé, révisé ou mis à jour le contenu des tiers et Fundata n'assume aucune responsabilité pour ces informations.