

FNB neutre au marché Anti-bêta É.-U. – couv. \$CAN AGF

APERÇU DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Le Fonds détient des positions acheteur et vendeur en swaps sur rendement total pour avoir une exposition à l'indice américain Dow Jones à coefficient bêta faible et à l'indice américain Dow Jones à coefficient bêta élevé. Le tableau Portefeuille par secteur ci-dessous comprend les swaps par l'intermédiaire desquels le Fond obtient une exposition indirecte aux secteurs des indices.

Portefeuille par pays	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
Positions acheteur :	
États-Unis	102,2
Trésorerie et équivalents de trésorerie	84,6
Contrats de change à terme	2,5
Israël	0,4
Autres actifs (passifs) nets	0,2
Positions vendeur :	
États-Unis	(89,6)
Suisse	(0,3)

Portefeuille par secteur	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
Positions acheteur :	
Trésorerie et équivalents de trésorerie	84,6
Placements à court terme	23,4
Industrie	18,7
Finance	17,3
Technologies de l'information	16,5
Consommation discrétionnaire	13,4
Soins de santé	12,6
Immobilier	7,6
Matériaux	6,5
Biens de consommation de base	5,7
Services aux collectivités	5,0
Services de communications	5,0
Énergie	4,2
Contrats de change à terme	2,5
Swap (volet en trésorerie)	0,8
Autres actifs (passifs) nets	0,2
Positions vendeur :	
Finance	(20,9)
Industrie	(20,3)
Technologies de l'information	(17,4)
Consommation discrétionnaire	(15,3)
Soins de santé	(14,4)

FNB neutre au marché Anti-bêta É.-U. – couv. \$CAN AGF (suite)

APERÇU DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Portefeuille par secteur (suite)	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
Immobilier	(8,5)
Matériaux	(6,9)
Biens de consommation de base	(5,7)
Services de communications	(5,2)
Services aux collectivités	(5,1)
Énergie	(4,3)

Portefeuille par catégorie d'actifs	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
Positions acheteur :	
Trésorerie et équivalents de trésorerie	84,6
Actions américaines	76,1
Placements à court terme	23,4
Swaps – Acheteur	2,7
Contrats de change à terme	2,5
Actions internationales	0,4
Autres actifs (passifs) nets	0,2
Positions vendeur :	
Actions américaines	(83,8)
Swaps – Vendeur	(5,8)
Actions internationales	(0,3)

Portefeuille par notation de crédit**	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
AA	25,9
A	81,5

Principaux placements	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
Positions acheteur :	
Trésorerie et équivalents de trésorerie	84,6
Trésor américain**	23,4
Swap sur le rendement total de l'indice Dow Jones U.S. Low Beta	2,7
United States Steel Corporation	0,5
Confluent Inc.	0,5
White Mountains Insurance Group Limited	0,5
Apellis Pharmaceuticals Inc.	0,5
Ulta Beauty Inc.	0,5

FNB neutre au marché Anti-bêta É.-U. – couv. \$CAN AGF (suite)

APERÇU DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Principaux placements (suite)	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
Dick's Sporting Goods Inc.	0,5
ON Semiconductor Corporation	0,4
FMC Corporation	0,4
Lattice Semiconductor Corporation	0,4
Aspen Technology Inc.	0,4
Vertex Pharmaceuticals Inc.	0,4
Markel Group Inc.	0,4
Physicians Realty Trust	0,4
PTC Inc.	0,4
Sarepta Therapeutics Inc.	0,4
The JM Smucker Company	0,4
Five Below Inc.	0,4
Neurocrine Biosciences Inc.	0,4
Willscot Mobile Mini Holdings Corporation	0,4
Alkermes PLC	0,4
NetApp Inc.	0,4
NewMarket Corporation	0,4
Total partiel	120,1
Positions vendeur :	
Swap sur le rendement total de l'indice Dow Jones U.S. High Beta	(5,8)
Sunrun Inc.	(0,6)
Carvana Company	(0,6)
Affirm Holdings Inc.	(0,6)
Opendoor Technologies Inc.	(0,6)
Robinhood Markets Inc.	(0,5)
Illumina Inc.	(0,5)
Coinbase Global Inc.	(0,5)
Unity Software Inc.	(0,5)
Lyft Inc.	(0,5)
Thor Industries Inc.	(0,5)
Rivian Automotive Inc.	(0,5)
Zillow Group Inc.	(0,5)
DocuSign Inc.	(0,5)
Norwegian Cruise Line Holdings Limited	(0,5)
PVH Corporation	(0,5)
MicroStrategy Inc.	(0,5)
Western Alliance Bancorporation	(0,5)
UiPath Inc.	(0,5)
Blueprint Medicines Corporation	(0,5)

FNB neutre au marché Anti-bêta É.-U. – couv. \$CAN AGF (suite)

APERÇU DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2023

Principaux placements (suite)	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
Snap Inc.	(0,5)
ZoomInfo Technologies Inc.	(0,5)
The Gap Inc.	(0,5)
Boston Properties Inc.	(0,5)
10X Genomics Inc.	(0,5)
Total partiel	(18,2)
Valeur liquidative totale (en milliers de \$)	302 510 \$

** Toutes les références à une notation de crédit ont été obtenues auprès de Standard & Poor's et/ou de Dominion Bond Rating Service. Dans les cas où plus d'une note a été obtenue pour un même titre, la note la plus faible a été utilisée.

** Instruments de créance

L'aperçu du portefeuille peut varier en fonction des opérations courantes du Fonds. La prochaine mise à jour trimestrielle sera comprise dans le Rapport intermédiaire de la direction sur le rendement du fonds au 31 mars 2024.

^{MD / MC} Le logo « AGF » et toutes les marques associées sont des marques déposées de La Société de Gestion AGF Limitée et sont utilisés aux termes de licences.