

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

APERÇU DU PORTEFEUILLE

Au 30 juin 2023

Portefeuille par pays	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
Positions acheteur :	
États-Unis	96,2
Trésorerie et équivalents de trésorerie	86,3
Contrats de change à terme	2,1
Autres actifs (passifs) nets	0,4
Positions vendeur :	
États-Unis	(84,6)
Australie	(0,4)

Portefeuille par secteur	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
Positions acheteur :	
Trésorerie et équivalents de trésorerie	86,3
Industrie	18,8
Placements à court terme	16,9
Finance	16,4
Technologies de l'information	15,6
Consommation discrétionnaire	13,1
Soins de santé	12,8
Immobilier	7,0
Matériaux	5,9
Services aux collectivités	5,3
Biens de consommation de base	5,0
Services de communications	4,9
Énergie	3,8
Contrats de change à terme	2,1
Swap (volet en trésorerie)	0,3
Autres actifs (passifs) nets	0,4
Positions vendeur :	
Industrie	(19,7)
Finance	(17,6)
Technologies de l'information	(15,5)
Consommation discrétionnaire	(15,1)
Soins de santé	(13,0)
Immobilier	(7,6)
Matériaux	(6,2)
Biens de consommation de base	(5,4)
Services aux collectivités	(5,3)
Services de communications	(5,1)
Énergie	(4,1)

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

APERÇU DU PORTEFEUILLE

Au 30 juin 2023

Portefeuille par catégorie d'actifs	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
Positions acheteur :	
Trésorerie et équivalents de trésorerie	86,3
Actions américaines	79,1
Placements à court terme	16,9
Contrats de change à terme	2,1
Swaps – Acheteur	0,2
Autres actifs (passifs) nets	0,4
Positions vendeur :	
Actions américaines	(82,0)
Swaps – Vendeur	(2,6)
Actions internationales	(0,4)

Portefeuille par notation de crédit**	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
AAA	16,9
AA	2,1
A	83,9

Principaux placements	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
Positions acheteur :	
Trésorerie et équivalents de trésorerie	86,3
Trésor américain**	16,9
Chart Industries Inc.	0,5
Pure Storage Inc.	0,5
Jabil Inc.	0,5
AutoNation Inc.	0,5
Booz Allen Hamilton Holding Corporation	0,5
Carlisle Companies Inc.	0,5
CACI International Inc.	0,5
Palo Alto Networks Inc.	0,5
Science Applications International Corporation	0,4
PACCAR Inc.	0,4
Lumentum Holdings Inc.	0,4
Penske Automotive Group Inc.	0,4
Allison Transmission Holdings Inc.	0,4
Huntington Ingalls Industries Inc.	0,4
Curtiss-Wright Corporation	0,4
BWX Technologies Inc.	0,4
Avnet Inc.	0,4

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

APERÇU DU PORTEFEUILLE
Au 30 juin 2023

Principaux placements (suite)	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
Analog Devices Inc.	0,4
Landstar System Inc.	0,4
Snap-on Inc.	0,4
Corning Inc.	0,4
Sabra Health Care REIT Inc.	0,4
Crown Holdings Inc.	0,4
Total partiel	113,2
Positions vendeur :	
Swap sur le rendement total de l'indice Dow Jones U.S. High Beta	(2,6)
Zillow Group Inc.	(0,8)
Wayfair Inc.	(0,7)
Opendoor Technologies Inc.	(0,6)
Carnival Corporation	(0,6)
Equitrans Midstream Corporation	(0,6)
Unity Software Inc.	(0,6)
Norwegian Cruise Line Holdings Limited	(0,5)
MongoDB Inc.	(0,5)
WEX Inc.	(0,5)
Five9 Inc.	(0,5)
Fox Factory Holding Corporation	(0,5)
Avis Budget Group Inc.	(0,5)
Tesla Inc.	(0,5)
WESCO International Inc.	(0,5)
Royal Caribbean Cruises Limited	(0,5)
Vertiv Holdings LLC	(0,5)
RH	(0,5)
Delta Air Lines Inc.	(0,5)
The Chemours Company	(0,5)
Chewy Inc.	(0,5)
JetBlue Airways Corporation	(0,5)
Guardant Health Inc.	(0,5)
Align Technology Inc.	(0,5)
Confluent Inc.	(0,5)
Total partiel	(15,5)
Valeur liquidative totale (en milliers de \$)	379 225 \$

** 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 annuel de la direction sur le rendement du fonds au 30 septembre 2023.

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.