

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

APERÇU DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2019

Portefeuille par pays	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
États-Unis – Longues	140,2
États-Unis – Courtes	(104,0)
Trésorerie et équivalents de trésorerie	7,8
Contrats de change à terme	2,2
Royaume-Uni	0,3

Portefeuille par secteur	Pourcentage de la valeur liquidative (%)	
	Longues	Courtes
Placements à court terme	38,6	-
Technologies de l'information	16,3	(16,4)
Finance	15,3	(15,8)
Biens industriels	13,6	(14,0)
Consommation discrétionnaire	12,2	(12,6)
Soins de santé	11,4	(11,3)
Immobilier	8,9	(9,4)
Trésorerie et équivalents de trésorerie	7,8	-
Services aux collectivités	5,2	(5,1)
Consommation de base	5,1	(5,3)
Matériels	5,1	(5,1)
Services de communications	4,6	(4,3)
Énergie	4,2	(4,7)
Contrats de change à terme	2,2	-

Portefeuille par catégorie d'actifs	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
Swaps – Courtes	(104,0)
Actions américaines – Longues	56,8
Swaps – Longues	44,8
Placements à court terme	38,6
Trésorerie et équivalents de trésorerie	7,8
Contrats de change à terme	2,2
Actions internationales	0,3

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

APERÇU DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2019

Portefeuille par notation de crédit**	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
AAA	38,6
AA	2,2
A	(51,4)

Principaux placements	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
Swap sur rendement total – pos. courte – indice Dow Jones U.S. Thematic Market Neutral Anti-Beta	(104,0)
Swap sur rendement total – pos. longue – indice Dow Jones U.S. Thematic Market Neutral Anti-Beta	44,8
Gouvernement américain**	38,6
NVR Inc.	0,4
Match Group Inc.	0,3
Cirrus Logic Inc.	0,3
Newmont Goldcorp Corporation	0,3
Bristol-Myers Squibb Company	0,3
Horizon Therapeutics PLC	0,3
Eli Lilly & Company	0,3
American Tower Corporation	0,3
LogMeIn Inc.	0,3
IAC/InterActiveCorporation	0,3
Cabot Oil & Gas Corporation	0,3
Activision Blizzard Inc.	0,3
ConocoPhillips	0,3
Kinder Morgan Inc.	0,3
Anthem Inc.	0,3
NuVasive Inc.	0,3
Columbia Sportswear Company	0,3
Bunge Limited	0,3
Graco Inc.	0,3
Tyler Technologies Inc.	0,3
Helen of Troy Limited	0,3
Cintas Corporation	0,3
Valeur liquidative totale (en milliers de dollars)	164 158 \$

** Toutes les références à une notation de crédit ont été obtenues auprès de Standard & Poor's 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 2020.

^{MC} Le logo AGFiQ est une marque déposée de La Société de Gestion AGF Limitée et est utilisée aux termes d'une licence.