

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

APERÇU DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2024

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	80,4
Trésorerie et équivalents de trésorerie	83,5
Contrats de change à terme	(2,5)
Autres actifs (passifs) nets	0,2
Positions vendeur :	
États-Unis	(60,7)
Israël	(0,3)
Thaïlande	(0,3)
Suisse	(0,3)

Portefeuille par secteur	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
Positions acheteur :	
Trésorerie et équivalents de trésorerie	83,5
Placements à court terme	17,0
Industrie	16,2
Finance	14,8
Technologies de l'information	13,9
Consommation discrétionnaire	11,7
Soins de santé	10,2
Immobilier	5,5
Biens de consommation de base	5,2
Matériaux	4,9
Services aux collectivités	4,2
Services de communications	3,9
Énergie	3,8
Swap (volet en trésorerie)	(0,1)
Contrats de change à terme	(2,5)
Autres actifs (passifs) nets	0,2
Positions vendeur :	
Industrie	(15,0)
Finance	(14,7)
Technologies de l'information	(14,1)
Consommation discrétionnaire	(11,4)
Soins de santé	(10,3)
Immobilier	(5,5)
Biens de consommation de base	(5,3)
Matériaux	(4,5)
Services aux collectivités	(4,2)
Services de communications	(3,8)
Énergie	(3,6)

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

APERÇU DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2024

Portefeuille par catégorie d'actifs	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
Positions acheteur :	
Trésorerie et équivalents de trésorerie	83,5
Actions américaines	58,3
Placements à court terme	17,0
Swaps – Acheteur	5,1
Contrats de change à terme	(2,5)
Autres actifs (passifs) nets	0,2
Positions vendeur :	
Actions américaines	(56,1)
Swaps – Vendeur	(4,6)
Actions internationales	(0,9)

Portefeuille par notation de crédit**	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
AA	14,5
A	84,0

Principaux placements	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
Positions acheteur :	
Trésorerie et équivalents de trésorerie	83,5
Trésor américain**	17,0
Swap sur le rendement total de l'indice Dow Jones U.S. Low Beta	5,1
AutoZone Inc.	0,5
Alaska Air Group Inc.	0,4
VeriSign Inc.	0,4
American Airlines Group Inc.	0,4
O'Reilly Automotive Inc.	0,4
Lululemon Athletica Inc.	0,3
Darden Restaurants Inc.	0,3
Willis Towers Watson PLC	0,3
Endeavor Group Holdings Inc.	0,3
V.F. Corporation	0,3
Fox Corporation	0,3
Juniper Networks Inc.	0,3
Newell Brands Inc.	0,3
Southwest Airlines Company	0,3
Cheniere Energy Inc.	0,3
United Airlines Holdings Inc.	0,3
Exact Sciences Corporation	0,3
AbbVie Inc.	0,3
Cisco Systems Inc.	0,3
APA Corporation	0,3
Entergy Corporation	0,3
Pfizer Inc.	0,3
Total partiel	112,8
Positions vendeur :	
Swap sur le rendement total de l'indice Dow Jones U.S. High Beta	(4,6)
Broadcom Inc.	(0,4)

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

APERÇU DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2024

Principaux placements (suite)	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
Marvell Technology Inc.	(0,4)
Tesla Inc.	(0,4)
Palantir Technologies Inc.	(0,4)
Rivian Automotive Inc.	(0,4)
Teradyne Inc.	(0,4)
Monolithic Power Systems Inc.	(0,4)
Roku Inc.	(0,3)
Doximity Inc.	(0,3)
The Goldman Sachs Group Inc.	(0,3)
Dick's Sporting Goods Inc.	(0,3)
AppLovin Corporation	(0,3)
Mobileye Global Inc.	(0,3)
Dollar Tree Inc.	(0,3)
Core & Main Inc.	(0,3)
Deckers Outdoor Corporation	(0,3)
Arista Networks Inc.	(0,3)
Antero Resources Corporation	(0,3)
Sarepta Therapeutics Inc.	(0,3)
The Estée Lauder Companies Inc.	(0,3)
Onto Innovation Inc.	(0,3)
Walgreens Boots Alliance Inc.	(0,3)
Cloudflare Inc.	(0,3)
Edwards Lifesciences Corporation	(0,3)
Total partiel	(12,5)
Valeur liquidative totale (en milliers de \$)	277 027 \$

** 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 2025.

^{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.