

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

APERÇU DU PORTEFEUILLE

Au 31 décembre 2021

Portefeuille par pays	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
États-Unis – Acheteur	70,5
Trésorerie et équivalents de trésorerie	27,5
États-Unis – Vendeur	1,0
Contrats de change à terme	0,9
Canada	0,1

Portefeuille par secteur	Pourcentage de la valeur liquidative (%)	
	Acheteur	Vendeur
Placements à court terme	40,4	–
Swap (volet en trésorerie)	28,0	–
Trésorerie et équivalents de trésorerie	27,5	–
Technologies de l'information	17,0	(15,7)
Biens industriels	14,5	(14,3)
Soins de santé	14,4	(13,1)
Finance	13,8	(13,2)
Consommation discrétionnaire	11,8	(11,4)
Immobilier	6,8	(7,1)
Matériels	5,5	(5,7)
Consommation de base	5,2	(5,1)
Services de communications	4,4	(4,3)
Services aux collectivités	4,1	(4,3)
Énergie	2,9	(3,0)
Contrats de change à terme	0,9	–

Portefeuille par catégorie d'actifs	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
Placements à court terme	40,4
Trésorerie et équivalents de trésorerie	27,5
Actions américaines – Acheteur	27,3
Swaps – Acheteur	2,8
Swaps – Vendeur	1,0
Contrats de change à terme	0,9
Actions canadiennes – Acheteur	0,1

Portefeuille par notation de crédit**	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
AAA	40,4
AA	0,9
A	31,3

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

APERÇU DU PORTEFEUILLE
Au 31 décembre 2021

Principaux placements	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
Bons du Trésor américain**	40,4
Trésorerie et équivalents de trésorerie	27,5
Swap sur le rendement total de l'indice Dow Jones U.S. Low Beta	2,8
Swap sur le rendement total de l'indice Dow Jones U.S. High Beta	1,0
MarketAxess Holdings Inc.	0,2
Vir Biotechnology Inc.	0,2
Cerner Corporation	0,2
SBA Communications Corporation	0,2
Northrop Grumman Corporation	0,2
Penumbra Inc.	0,2
Pool Corporation	0,2
Domino's Pizza Inc.	0,2
Public Storage	0,2
Eli Lilly and Company	0,2
Biohaven Pharmaceutical Holding Company Limited	0,2
Vertex Pharmaceuticals Inc.	0,2
ACADIA Pharmaceuticals Inc.	0,2
United Therapeutics Corporation	0,2
Black Knight Inc.	0,2
Tyler Technologies Inc.	0,2
Hormel Foods Corporation	0,2
McDonald's Corporation	0,2
Life Storage Inc.	0,2
International Business Machines Corporation	0,2
Lockheed Martin Corporation	0,2
Valeur liquidative totale (en milliers de dollars)	325 907 \$

** 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 2022.

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

