

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

APERÇU DU PORTEFEUILLE

Au 30 juin 2022

Portefeuille par pays	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
États-Unis – Acheteur	48,7
Trésorerie et équivalents de trésorerie	37,2
États-Unis – Vendeur	15,9
Contrats de change à terme	(2,0)

Portefeuille par secteur	Pourcentage de la valeur liquidative (%)	
	Acheteur	Vendeur
Trésorerie et équivalents de trésorerie	37,2	–
Swap (volet en trésorerie)	29,2	–
Placements à court terme	28,4	–
Technologies de l'information	14,5	(13,6)
Biens industriels	13,3	(12,1)
Finance	13,1	(11,6)
Soins de santé	11,6	(11,8)
Consommation discrétionnaire	10,9	(9,6)
Immobilier	6,6	(5,9)
Matériels	4,6	(3,8)
Services aux collectivités	4,5	(4,2)
Consommation de base	4,3	(4,1)
Services de communications	3,5	(3,3)
Énergie	2,4	(2,3)
Contrats de change à terme	(2,0)	–

Portefeuille par catégorie d'actifs	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
Trésorerie et équivalents de trésorerie	37,2
Placements à court terme	28,4
Actions américaines – Acheteur	24,1
Swaps – Vendeur	15,9
Swaps – Acheteur	(3,8)
Contrats de change à terme	(2,0)

Portefeuille par notation de crédit**	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
AAA	28,4
AA	(2,0)
A	49,3

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

APERÇU DU PORTEFEUILLE

Au 30 juin 2022

Principaux placements	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
Trésorerie et équivalents de trésorerie	37,2
Bons du Trésor américain**	28,4
Swap sur le rendement total de l'indice Dow Jones U.S. High Beta	15,9
Swap sur le rendement total de l'indice Dow Jones U.S. Low Beta	(3,8)
O'Reilly Automotive Inc.	0,2
Dollar Tree Inc.	0,2
White Mountains Insurance Group Limited	0,2
Dollar General Corporation	0,1
Exelixis Inc.	0,1
Fair Isaac Corporation	0,1
Neurocrine Biosciences Inc.	0,1
Mercury Systems Inc.	0,1
BWX Technologies Inc.	0,1
FactSet Research Systems Inc.	0,1
Cboe Global Markets Inc.	0,1
General Mills Inc.	0,1
Grand Canyon Education Inc.	0,1
International Business Machines Corporation	0,1
Vertex Pharmaceuticals Inc.	0,1
CACI International Inc.	0,1
PS Business Parks Inc.	0,1
Everest Re Group Limited	0,1
Vir Biotechnology Inc.	0,1
Science Applications International Corporation	0,1
Dell Technologies Inc.	0,1
Valeur liquidative totale (en milliers de dollars)	261 583 \$

** 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 annuel de la direction sur le rendement du fonds au 30 septembre 2022.

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

