

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

APERÇU DU PORTEFEUILLE

Au 30 juin 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	84,3
Trésorerie et équivalents de trésorerie	82,2
Belgique	0,3
Contrats de change à terme	(0,5)
Autres actifs (passifs) nets	0,2
Positions vendeur :	
États-Unis	(66,2)
Suisse	(0,3)

Portefeuille par secteur	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
Positions acheteur :	
Trésorerie et équivalents de trésorerie	82,2
Industrie	16,1
Placements à court terme	16,0
Finance	15,4
Technologies de l'information	13,8
Consommation discrétionnaire	12,2
Soins de santé	11,9
Immobilier	6,7
Matériaux	5,2
Services aux collectivités	4,9
Biens de consommation de base	4,8
Énergie	4,1
Services de communications	4,1
Swap (volet en trésorerie)	0,9
Contrats de change à terme	(0,5)
Autres actifs (passifs) nets	0,2
Positions vendeur :	
Finance	(16,0)
Industrie	(15,7)
Technologies de l'information	(13,7)
Consommation discrétionnaire	(12,9)

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

APERÇU DU PORTEFEUILLE

Au 30 juin 2024

Portefeuille par secteur (suite)	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
Soins de santé	(11,0)
Immobilier	(6,6)
Matériaux	(5,0)
Biens de consommation de base	(4,7)
Services aux collectivités	(4,6)
Services de communications	(4,1)
Énergie	(3,7)

Portefeuille par catégorie d'actifs	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
Positions acheteur :	
Trésorerie et équivalents de trésorerie	82,2
Actions américaines	64,0
Placements à court terme	16,0
Swaps – Acheteur	4,3
Actions internationales	0,3
Contrats de change à terme	(0,5)
Autres actifs (passifs) nets	0,2
Positions vendeur :	
Actions américaines	(63,6)
Swaps – Vendeur	(2,6)
Actions internationales	(0,3)

Portefeuille par notation de crédit**	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
AA	15,5
A	83,9

Principaux placements	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
Positions acheteur :	
Trésorerie et équivalents de trésorerie	82,2
Trésor américain**	16,0
Swap sur le rendement total de l'indice Dow Jones U.S. Low Beta	4,3
Sarepta Therapeutics Inc.	0,5
Chipotle Mexican Grill Inc.	0,4
AutoZone Inc.	0,4

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

APERÇU DU PORTEFEUILLE

Au 30 juin 2024

Principaux placements (suite)	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
Texas Pacific Land Corporation	0,4
Ollie's Bargain Outlet Holding Inc.	0,4
Eli Lilly & Company	0,4
Elevance Health Inc.	0,4
Motorola Solutions Inc.	0,4
Cheniere Energy Inc.	0,4
Guidewire Software Inc.	0,4
Hilton Worldwide Holdings Inc.	0,4
Humana Inc.	0,4
H&R Block Inc.	0,4
CACI International Inc.	0,4
AT&T Inc.	0,4
NetApp Inc.	0,4
AbbVie Inc.	0,4
Omega Healthcare Investors Inc.	0,4
Honeywell International Inc.	0,4
BioMarin Pharmaceutical Inc.	0,3
UnitedHealth Group Inc.	0,3
V.F. Corporation	0,3
Total partiel	111,1
Positions vendeur :	
Swap sur le rendement total de l'indice Dow Jones U.S. High Beta	(2,6)
Chewy Inc.	(0,5)
Broadcom Inc.	(0,4)
Rivian Automotive Inc.	(0,4)
Penn Entertainment Inc.	(0,4)
Carvana Company	(0,4)
Denali Therapeutics Inc.	(0,4)
Coherent Corporation	(0,4)
Palantir Technologies Inc.	(0,4)
Saia Inc.	(0,4)
Carnival Corporation	(0,4)
Amkor Technology Inc.	(0,4)
Caesars Entertainment Inc.	(0,4)
Zillow Group Inc.	(0,4)
Expedia Group Inc.	(0,4)
MGM Resorts International	(0,4)
The Boston Beer Company Inc.	(0,4)

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

APERÇU DU PORTEFEUILLE

Au 30 juin 2024

Principaux placements (suite)	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
ICU Medical Inc.	(0,4)
Vornado Realty Trust	(0,4)
Lumentum Holdings Inc.	(0,4)
Zscaler Inc.	(0,4)
Uber Technologies Inc.	(0,4)
Norwegian Cruise Line Holdings Limited	(0,4)
Peloton Interactive Inc.	(0,4)
Roblox Corporation	(0,4)
Total partiel	(12,3)
Valeur liquidative totale (en milliers de \$)	279 339 \$

** 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 2024.

^{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.