

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

## APERÇU DU PORTEFEUILLE

Au 30 juin 2021

Portefeuille par pays	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
États-Unis – Acheteur	118,3
États-Unis – Vendeur	(32,6)
Trésorerie et équivalents de trésorerie	16,8
Contrats de change à terme	(2,6)
Irlande	0,1

Portefeuille par secteur	Pourcentage de la valeur liquidative (%)	
	Acheteur	Vendeur
Placements à court terme	78,4	–
Technologies de l'information	17,1	(16,9)
Trésorerie et équivalents de trésorerie	16,8	–
Finance	15,4	(14,2)
Biens industriels	13,9	(14,3)
Soins de santé	13,4	(12,8)
Consommation discrétionnaire	12,2	(11,4)
Immobilier	7,8	(7,6)
Swap (volet en trésorerie)	5,8	–
Consommation de base	5,4	(5,4)
Matériels	5,2	(5,4)
Services aux collectivités	4,9	(5,1)
Services de communications	4,0	(4,2)
Énergie	3,1	(3,5)
Contrats de change à terme	(2,6)	–

Portefeuille par catégorie d'actifs	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
Placements à court terme	78,4
Swaps – Vendeur	(32,6)
Actions américaines – Acheteur	28,2
Trésorerie et équivalents de trésorerie	16,8
Swaps – Acheteur	11,7
Contrats de change à terme	(2,6)
Actions internationales – Acheteur	0,1

Portefeuille par notation de crédit**	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
AAA	78,4
AA	(2,6)
A	(4,1)

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

### APERÇU DU PORTEFEUILLE

Au 30 juin 2021

Principaux placements	Pourcentage de la valeur liquidative (%)
Bons du Trésor américain**	78,4
Position vendeur sur contrat de swap sur le rendement total de l'indice Dow Jones U.S. Thematic Market Neutral Anti-Beta	(32,6)
Trésorerie et équivalents de trésorerie	16,8
Position acheteur sur contrat de swap sur le rendement total de l'indice Dow Jones U.S. Thematic Market Neutral Anti-Beta	11,7
AutoZone Inc.	0,2
Moderna Inc.	0,2
Peloton Interactive Inc.	0,2
ResMed Inc.	0,2
FibroGen Inc.	0,2
RingCentral Inc.	0,2
Zoom Video Communications Inc.	0,2
Smartsheet Inc.	0,2
Splunk Inc.	0,2
White Mountains Insurance Group Limited	0,2
Eli Lilly & Company	0,2
Datadog Inc.	0,2
O'Reilly Automotive Inc.	0,2
Exact Sciences Corporation	0,2
Alteryx Inc.	0,2
Dick's Sporting Goods Inc.	0,2
Penumbra Inc.	0,2
Northrop Grumman Corporation	0,2
MongoDB Inc.	0,2
Dollar General Corporation	0,2
Ares Management Corporation	0,2
<b>Valeur liquidative totale (en milliers de dollars)</b>	<b>162 423 \$</b>

\*\* 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 2021.

<sup>MC</sup> Le logo AGF est une marque déposée de La Société de Gestion AGF Limitée et est utilisée aux termes d'une licence.

