

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2018

Aperçu du portefeuille

Répartition du portefeuille	% de la valeur liquidative
Obligations	89,6
Obligations	89,6
Options achetées*	0,0
Positions vendeur sur contrats à terme**	0,0
Trésorerie et placements à court terme	8,0
Fonds/billets négociés en bourse	1,2
Autres éléments d'actif (de passif)	0,9
Actions	0,3
Options sur devises achetées†	0,0

Répartition régionale	% de la valeur liquidative
Canada	72,9
États-Unis	14,8
Trésorerie et placements à court terme	8,0
Royaume-Uni	1,1
Belgique	0,9
Autres éléments d'actif (de passif)	0,9
Bermudes	0,8
Brésil	0,3
Allemagne	0,1
Irlande	0,1
Israël	0,1

Répartition sectorielle	% de la valeur liquidative
Obligations de sociétés	46,0
Obligations provinciales	20,1
Obligations fédérales	14,8
Trésorerie et placements à court terme	8,0
Prêts à terme	6,4
Obligations d'État étrangères	2,3
Fonds/billets négociés en bourse	1,2
Autres éléments d'actif (de passif)	0,9
Énergie	0,1
Services financiers	0,1
Services publics	0,1

Exposition nette aux devises	% de la valeur liquidative
Dollar canadien	100,3
Dollar américain	(0,3)

* Les valeurs du capital théorique représentent 0,3 % de la valeur liquidative des options achetées.

** Les valeurs du capital théorique représentent -1,9 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans.

† Les valeurs du capital théorique représentent 5,5 % de la valeur liquidative des options sur devises achetées.

Les 25 principaux titres acheteur

Émetteur/Fonds sous-jacent	% de la valeur liquidative
Gouvernement du Canada 2,00 % 01-06-2028	10,3
Trésorerie et placements à court terme	8,0
Province de l'Ontario 2,90 % 02-06-2028	7,6
Province de Québec 2,75 % 01-09-2028	5,6
Gouvernement du Canada 2,75 % 01-12-2048	2,4
Banque Royale du Canada 2,95 % 01-05-2023	1,4
Obligations du Trésor des États-Unis 3,00 % 15-02-2048	1,3
Province de Québec 3,50 % 01-12-2048	1,3
Fortified Trust 1,67 % 23-07-2021	1,2
Fiducie cartes de crédit Eagle 2,63 % 17-10-2022	1,2
FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	1,2
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, taux variable 15-03-2023	1,1
Province de l'Ontario 2,90 % 02-06-2049	1,1
Province de Québec 2,75 % 01-09-2027	1,1
Province de l'Ontario 2,60 % 08-09-2023	1,0
Banque Nationale du Canada 1,96 % 30-06-2022	1,0
La Banque de Nouvelle-Écosse 2,98 % 17-04-2023	1,0
Banque de Montréal 2,27 % 11-07-2022	0,9
Enbridge Inc., taux variable 12-04-2078, rachetables 2028	0,7
Reliance LP 3,84 % 15-03-2025, rachetables 2025	0,7
Capital Power Corp. 4,28 % 18-09-2024, rachetables 2024	0,7
TransCanada PipeLines Ltd. 3,39 % 15-03-2028, rachetables 2027	0,7
La Banque de Nouvelle-Écosse 2,29 % 28-06-2024	0,7
Fairfax Financial Holdings Ltd. 4,70 % 16-12-2026, rachetables 2026	0,7
Brookfield Renewable Energy Partners ULC 3,63 % 15-01-2027, rachetables 2026	0,6

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **53,5**

Les 25 principaux titres vendeur

Émetteur	% de la valeur liquidative
Contrats à terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans**	0,0

Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **0,0**

Valeur liquidative totale du FNB **66,1 millions \$**

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 30 juin 2018 en raison des opérations de portefeuille continues du FNB. Les mises à jour trimestrielles des titres sont disponibles dans les 60 jours suivant la fin de chaque trimestre, sauf pour le trimestre se terminant le 31 mars, date de clôture de l'exercice du FNB, où elles sont disponibles dans les 90 jours.

