

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2018

Aperçu du portefeuille

Répartition du portefeuille	% de la valeur liquidative
Obligations	100,4
<i>Obligations</i>	100,4
<i>Options achetées*</i>	0,0
<i>Options vendues*</i>	(0,0)
Trésorerie et placements à court terme	3,4
Options sur devises achetées**	0,1
Actions	0,1
Autres éléments d'actif (de passif)	(4,0)

Répartition régionale	% de la valeur liquidative
États-Unis	81,0
Canada	15,2
Trésorerie et placements à court terme	3,4
Pays-Bas	1,6
Royaume-Uni	1,3
France	0,7
Colombie	0,6
Autres	0,1
Irlande	0,1
Autres éléments d'actif (de passif)	(4,0)

Répartition sectorielle	% de la valeur liquidative
Prêts à terme	87,3
Obligations fédérales	7,0
Obligations de sociétés	6,1
Trésorerie et placements à court terme	3,4
Autres	0,2
Autres éléments d'actif (de passif)	(4,0)

Exposition nette aux devises	% de la valeur liquidative
Dollar canadien	99,5
Dollar américain	0,5

Les 25 principaux titres acheteur

Émetteur	% de la valeur liquidative
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, taux variable 15-09-2023	7,0
Trésorerie et placements à court terme	3,4
RegionalCare Hospital Partners Holdings, prêt à terme de premier rang, taux variable 16-11-2025	1,5
Ultra Clean Holdings Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 27-08-2025	1,4
EagleTree-Carbide Acquisition Corp., prêt à terme de premier rang, taux variable 28-08-2024	1,4
Thor Industries Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 01-11-2025	1,2
GFL Environmental Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 31-05-2025	1,2
EnTrans International LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 29-10-2025	1,2
Rackspace Hosting Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 03-11-2023	1,2
Celestica Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 21-06-2025	1,2
Western Dental Services Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 23-06-2023	1,1
Renfro Corp., prêt à terme B de premier rang, taux variable 31-03-2021	1,1
Alchemy US Holdco LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 01-10-2025	1,1
Vyair Medical Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 06-04-2025	1,1
Frontera Generation Holdings LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 25-04-2025	1,0
MacDonald, Dettwiler and Associates Ltd., prêt à terme B de premier rang, taux variable 04-10-2024	1,0
Yak Access LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 26-06-2025	1,0
LifeScan Global Corp., prêt à terme de premier rang, taux variable 19-06-2024	1,0
Lifetime Brands Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 31-03-2025	1,0
Titan Acquisition Ltd., prêt à terme de premier rang, taux variable 16-03-2025	1,0
Zotec Partners LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 09-02-2024	1,0
Uber Technologies Inc. 8,00 % 01-11-2026, rachetables 2021	1,0
Pisces Midco Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 29-03-2025	1,0
IEA Energy Services LLC, prêt à terme de premier rang, taux variable 02-11-2024	1,0
Exela Intermediate LLC 10,00 % 15-07-2023, rachetables 2020	0,9

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **36,0**

* Les valeurs du capital théorique représentent 0,5 % de la valeur liquidative des options achetées et -0,1 % de la valeur liquidative des options vendues.

** Les valeurs du capital théorique représentent 12,4 % de la valeur liquidative des options sur devises achetées.



Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 31 décembre 2018

Les 25 principaux titres vendeur

Émetteur	% de la valeur liquidative
iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF option de vente souscrite @ 79,00 \$ éch. 18-04-2019*	(0,0)

Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	(0,0)
--	--------------

Valeur liquidative totale du FNB **716,5 millions \$**

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 31 décembre 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.

