

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2018

Aperçu du portefeuille

Répartition du portefeuille	% de la valeur liquidative
Obligations	97,6
Obligations	97,5
Positions vendeur sur contrats à terme*	0,1
Options achetées**	0,0
Trésorerie et placements à court terme	8,8
Actions	0,8
Autres éléments d'actif (de passif)	(7,2)

Répartition régionale	% de la valeur liquidative
Canada	68,3
États-Unis	18,0
Trésorerie et placements à court terme	8,8
Allemagne	7,0
Japon	3,6
Royaume-Uni	1,5
Autres éléments d'actif (de passif)	(7,2)

Répartition sectorielle	% de la valeur liquidative
Obligations de sociétés	89,2
Trésorerie et placements à court terme	8,8
Prêts à terme	5,7
Obligations fédérales	2,6
Énergie	0,3
Services publics	0,3
Services financiers	0,2
Autres	0,1
Autres éléments d'actif (de passif)	(7,2)

Exposition nette aux devises	% de la valeur liquidative
Dollar canadien	99,2
Dollar américain	0,8

* Les valeurs du capital théorique représentent -16,4 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations américaines à 5 ans.

** Les valeurs du capital théorique représentent 0,2 % de la valeur liquidative des options achetées.

Les 25 principaux titres acheteur

Émetteur	% de la valeur liquidative
Trésorerie et placements à court terme	8,8
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 18-02-2020	3,7
Banque Royale du Canada, taux variable 11-02-2020	3,7
Dollarama inc., taux variable 16-03-2020	3,7
BMW Canada Inc., taux variable 14-06-2019	3,7
Central 1 Credit Union, taux variable 21-11-2018	3,7
Hydro One Inc., taux variable 21-03-2019	3,7
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 17-01-2019	3,7
Caterpillar Financial Services Ltd., taux variable 09-12-2019	3,7
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 22-03-2019	3,7
Nissan Motor Acceptance Corp., taux variable 13-01-2020	3,6
Crédit Toyota Canada Inc., taux variable 13-10-2020	3,4
Fonds de placement immobilier H&R, taux variable 23-07-2019	3,4
Banque HSBC Canada 2,17 % 29-06-2022	3,3
Vancouver City Savings Credit Union, taux variable 10-04-2019	3,1
John Deere Canada Funding Inc., taux variable 21-09-2020	2,8
Banque Manuvie du Canada, taux variable 27-01-2020, rachetables 2019	2,8
Bell Canada 3,00 % 03-10-2022, rachetables	2,8
Fiducie du Canada pour l'habitation n° 1, taux variable 15-03-2023	2,5
SmartCentres Real Estate Investment Trust, taux variable 21-12-2020	2,4
Banque de Montréal, taux variable 11-04-2019	1,9
Artis Real Estate Investment Trust, taux variable 07-02-2020	1,9
Services financiers Nissan Canada inc., taux variable 09-04-2019	1,9
Crédit VW Canada Inc., taux variable 30-03-2020	1,9
Charter Communications Operating LLC, taux variable 01-02-2024, rachetables 2024	1,8

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **81,6**

Les 25 principaux titres vendeur

Émetteur	% de la valeur liquidative
Contrats à terme sur obligations américaines à 5 ans*	0,1

Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **0,1**

Valeur liquidative totale du Fonds **53,9 millions \$**

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 30 juin 2018 en raison des opérations de portefeuille continues du Fonds. 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 Fonds, où elles sont disponibles dans les 90 jours.

