

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2018

Aperçu du portefeuille

Répartition du portefeuille	% de la valeur liquidative
Obligations	100,4
Obligations	100,4
Positions vendeur sur contrats à terme*	0,0
Options achetées**	0,0
Trésorerie et placements à court terme	1,9
Actions	0,5
Autres éléments d'actif (de passif)	(2,8)

Répartition régionale	% de la valeur liquidative
États-Unis	49,6
Canada	31,3
Royaume-Uni	5,7
Allemagne	3,1
Australie	2,7
Danemark	2,0
Belgique	2,0
Trésorerie et placements à court terme	1,9
Pays-Bas	1,5
Japon	1,5
Chili	1,5
Autres éléments d'actif (de passif)	(2,8)

Répartition sectorielle	% de la valeur liquidative
Obligations de sociétés	94,9
Prêts à terme	5,3
Trésorerie et placements à court terme	1,9
Énergie	0,3
Obligations fédérales	0,2
Services publics	0,2
Autres éléments d'actif (de passif)	(2,8)

Exposition nette aux devises	% de la valeur liquidative
Dollar américain	99,6
Dollar canadien	0,4

Les 25 principaux titres acheteur

Émetteur	% de la valeur liquidative
Wells Fargo Bank National Association, taux variable 06-12-2019	2,5
Vancouver City Savings Credit Union, taux variable 10-04-2019	2,5
Banque Manuvie du Canada, taux variable 27-01-2020, rachetables 2019	2,3
HSBC Holdings PLC, taux variable 25-05-2021	2,1
Banque de Montréal, taux variable 12-12-2019	2,0
Danske Bank AS, taux variable 06-09-2019	2,0
Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc. 2,20 % 01-08-2018	2,0
Banque Royale du Canada, taux variable 07-12-2018	2,0
Trésorerie et placements à court terme	1,9
Charter Communications Operating LLC, taux variable 01-02-2024, rachetables 2024	1,7
Morgan Stanley, taux variable 27-01-2020	1,7
Dollarama inc., taux variable 16-03-2020	1,7
John Deere Canada Funding Inc., taux variable 21-09-2020	1,6
Bank of America Corp., taux variable, 21-07-2021, rachetables 2020	1,6
Kraft Foods Group Inc. 6,13 % 23-08-2018	1,6
CVS Health Corp., taux variable 09-03-2020	1,6
Gilead Sciences Inc. 1,85 % 04-09-2018	1,6
Compagnie Crédit Ford du Canada, taux variable 01-12-2020	1,6
Gaz Métro inc. 1,52 % 25-05-2020	1,6
Heathrow Funding Ltd. 4,00 % 03-07-2019	1,6
Enercare Solutions Inc. 3,38 % 21-02-2022, rachetables 2022	1,5
Citigroup Inc., taux variable 01-09-2023, rachetables 2022	1,5
BMW Canada Inc., taux variable 14-06-2019	1,5
Verizon Communications Inc., taux variable 16-03-2022	1,5
Kellogg Co. 4,15 % 15-11-2019	1,5

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **44,7**

Les 25 principaux titres vendeur

Émetteur	% de la valeur liquidative
Contrats à terme sur obligations du Trésor américain à 2 ans*	0,0

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

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

* Les valeurs du capital théorique représentent -8,5 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations du Trésor américain à 2 ans.

** Les valeurs du capital théorique représentent 1,7 % de la valeur liquidative des options achetées.

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.

