

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2017

Aperçu du portefeuille

Répartition du portefeuille	% de la valeur liquidative
Actions	74,1
Obligations	21,8
Obligations	21,8
Positions vendeur sur contrats à terme*	0,0
Options achetées**	0,0
Fonds/billets négociés en bourse	2,2
Fonds communs de placement	2,1
Trésorerie et placements à court terme	0,3
Options sur devises achetées†	0,0
Autres éléments d'actif (de passif)	(0,5)

Répartition régionale	% de la valeur liquidative
Canada	90,9
États-Unis	7,2
Danemark	0,5
Trésorerie et placements à court terme	0,3
Nouvelle-Zélande	0,3
Australie	0,3
Royaume-Uni	0,2
Belgique	0,2
Bahamas	0,2
Portugal	0,2
Japon	0,1
Bésil	0,1
Autres éléments d'actif (de passif)	(0,5)

Répartition sectorielle	% de la valeur liquidative
Services financiers	24,4
Énergie	11,6
Obligations de sociétés	11,3
Produits industriels	10,6
Matières	7,0
Consommation courante	5,7
Services publics	5,4
Obligations provinciales	4,8
Consommation discrétionnaire	4,2
Immobilier	3,4
Autres	3,3
Prêts à terme	2,4
Fonds/billets négociés en bourse	2,2
Fonds communs de placement	2,1
Services de télécommunications	1,8
Trésorerie et placements à court terme	0,3
Autres éléments d'actif (de passif)	(0,5)

Exposition nette aux devises	% de la valeur liquidative
Dollar canadien	97,1
Dollar américain	2,8
Euro	0,1

Les 25 principaux titres acheteur

Émetteur	% de la valeur liquidative
La Banque de Nouvelle-Écosse	4,1
Banque Royale du Canada	3,9
Enbridge Inc.	3,4
Compagnie des chemins de fer nationaux du Canada	3,3
La Banque Toronto-Dominion	3,0
Banque Canadienne Impériale de Commerce	3,0
CAE Inc.	2,3
Société Financière Manuvie	2,2
Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée	2,2
Vanguard Mid-Cap Value ETF	2,2
Banque de Montréal	2,1
Alimentation Couche-Tard Inc.	2,1
TransCanada Corp.	2,0
Canadian Natural Resources Ltd.	2,0
Financière Sun Life inc.	1,8
Northland Power Inc.	1,6
Les Compagnies Loblaw Itée	1,6
Province de Québec 3,50 % 01-12-2045	1,5
Potash Corp. of Saskatchewan Inc.	1,5
ECN Capital Corp.	1,5
La Société Canadian Tire Ltée	1,4
Empire Co. Ltd.	1,4
Industrielle Alliance, Assurance et services financiers inc.	1,4
Brookfield Property Partners LP	1,3
WestJet Airlines Ltd.	1,3

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **54,1**

Les 25 principaux titres vendeur

Émetteur	% de la valeur liquidative
Contrats à terme sur obligations canadiennes à 10 ans*	0,0
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 Fonds **725,6 millions \$**

* Les valeurs du capital théorique représentent -0,9 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations canadiennes à 10 ans et -1,2 % de la valeur liquidative des des contrats à terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans.

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

† Les valeurs du capital théorique représentent 0,8 % de la valeur liquidative des options sur devises achetées.

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 30 juin 2017, 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.

