

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2017

Aperçu du portefeuille

Répartition du portefeuille	% de la valeur liquidative
Actions	96,1
<i>Actions</i>	94,9
<i>Options achetées*</i>	1,3
<i>Options vendues*</i>	(0,1)
Autres éléments d'actif (de passif)	2,4
Fonds/billets négociés en bourse	2,0
Trésorerie et placements à court terme	(0,5)

Répartition régionale	% de la valeur liquidative
États-Unis	97,9
Autres éléments d'actif (de passif)	2,4
Puerto Rico	0,1
Bermudes	0,1
Trésorerie et placements à court terme	(0,5)

Répartition sectorielle	% de la valeur liquidative
Technologie de l'information	21,2
Soins de santé	13,8
Services financiers	13,5
Consommation discrétionnaire	11,9
Produits industriels	9,5
Consommation courante	8,6
Énergie	5,0
Immobilier	3,9
Services publics	3,4
Matières	2,6
Autres éléments d'actif (de passif)	2,4
Fonds/billets négociés en bourse	2,0
Services de télécommunications	1,5
Autres	1,2
Trésorerie et placements à court terme	(0,5)

Exposition nette aux devises	% de la valeur liquidative
Dollar canadien	51,7
Dollar américain	48,1
Livre sterling	0,2

* Les valeurs du capital théorique représentent 82,1 % de la valeur liquidative des options achetées et -28,8 % de la valeur liquidative des options vendues.

Les 25 principaux titres acheteur

Émetteur	% de la valeur liquidative
Johnson & Johnson	3,0
JPMorgan Chase & Co.	2,5
Pfizer Inc.	2,3
Altria Group Inc.	2,1
McDonald's Corp.	2,0
SPDR S&P 500 ETF Trust	2,0
Apple Inc.	1,9
UnitedHealth Group Inc.	1,8
Exxon Mobil Corp.	1,7
PNC Financial Services Group Inc.	1,7
Texas Instruments Inc.	1,7
Danaher Corp.	1,6
Humana Inc.	1,6
Raytheon Co.	1,6
eBay Inc.	1,6
Intuit Inc.	1,6
Kimberly-Clark Corp.	1,6
Applied Materials Inc.	1,6
Honeywell International Inc.	1,5
Norfolk Southern Corp.	1,5
The Walt Disney Co.	1,5
Northrop Grumman Corp.	1,5
CBS Corp.	1,5
The TJX Companies Inc.	1,4
Zoetis Inc.	1,3

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	44,1
---	-------------

Les 25 principaux titres vendeur

Émetteur	% de la valeur liquidative
SPDR S&P 500 ETF Trust – option d'achat souscrite @ 244,00 \$ (éch. 07-07-2017)	(0,0)
SPDR S&P 500 ETF Trust – option d'achat souscrite @ 244,50 \$ (éch. 14-07-2017)	(0,0)
SPDR S&P 500 ETF Trust – option d'achat souscrite @ 245,00 \$ (éch. 21-07-2017)	(0,1)

Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	(0,1)
--	--------------

Valeur liquidative totale du Fonds	79,9 millions \$
---	-------------------------

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.