

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2020

Aperçu du portefeuille

| Répartition du portefeuille | % de la valeur liquidative |
|---|----------------------------|
| Actions | 75,1 |
| Obligations | 21,0 |
| Obligations | 21,0 |
| Positions vendeur sur contrats à terme* | (0,0) |
| Fonds communs de placement | 2,4 |
| Fonds/billets négociés en bourse | 0,8 |
| Autres éléments d'actif (de passif) | 0,5 |
| Trésorerie et placements à court terme | 0,2 |
| Options sur devises achetées** | 0,0 |

| Répartition régionale | % de la valeur liquidative |
|--|----------------------------|
| Canada | 66,5 |
| États-Unis | 27,1 |
| Suisse | 1,4 |
| Royaume-Uni | 1,0 |
| Allemagne | 0,9 |
| Chine | 0,9 |
| Japon | 0,7 |
| Autres éléments d'actif (de passif) | 0,5 |
| Autre | 0,3 |
| Australie | 0,3 |
| Trésorerie et placements à court terme | 0,2 |
| Bahamas | 0,1 |
| Mexique | 0,1 |

| Répartition sectorielle | % de la valeur liquidative |
|--|----------------------------|
| Services financiers | 17,3 |
| Obligations de sociétés | 11,1 |
| Consommation courante | 9,8 |
| Technologie de l'information | 9,4 |
| Soins de santé | 6,7 |
| Services de communication | 6,7 |
| Services publics | 5,7 |
| Produits industriels | 5,6 |
| Consommation discrétionnaire | 5,5 |
| Obligations provinciales | 5,3 |
| Matières | 4,0 |
| Autre | 3,6 |
| Énergie | 3,5 |
| Obligations d'État étrangères | 2,7 |
| Fonds communs de placement | 2,4 |
| Autres éléments d'actif (de passif) | 0,5 |
| Trésorerie et placements à court terme | 0,2 |

| Exposition nette aux devises | % de la valeur liquidative |
|------------------------------|----------------------------|
| Dollar canadien | 79,8 |
| Dollar américain | 15,6 |
| Franc suisse | 1,4 |
| Dollar de Hong Kong | 0,9 |
| Euro | 0,8 |
| Livre sterling | 0,8 |
| Yen japonais | 0,7 |

Les 25 principales positions acheteur

| Émetteur | % de la valeur liquidative |
|---------------------------------------|----------------------------|
| Brookfield Asset Management Inc. | 4,1 |
| Dollarama inc. | 3,0 |
| Johnson & Johnson | 2,4 |
| La Banque de Nouvelle-Écosse | 2,4 |
| CCL Industries Inc. | 2,3 |
| Banque Royale du Canada | 2,3 |
| La Banque Toronto-Dominion | 2,3 |
| Fortis Inc. | 2,1 |
| Intact Corporation financière | 2,1 |
| Emera Inc. | 2,1 |
| Société Financière Manuvie | 2,0 |
| Onex Corp. | 2,0 |
| Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée | 2,0 |
| Groupe CGI inc. | 1,9 |
| Premium Brands Holdings Corp. | 1,9 |
| Shaw Communications Inc. | 1,9 |
| Alphabet Inc. | 1,9 |
| Alimentation Couche-Tard inc. | 1,9 |
| TELUS Corp. | 1,8 |
| Open Text Corp. | 1,7 |
| Franco-Nevada Corp. | 1,7 |
| Microsoft Corp. | 1,7 |
| The Procter & Gamble Co. | 1,6 |
| Becton, Dickinson and Co. | 1,6 |
| Oracle Corp. | 1,5 |

| | |
|---|-------------|
| Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale | 52,2 |
|---|-------------|

Les 25 principales positions vendeur

| Émetteur | % de la valeur liquidative |
|--|----------------------------|
| Contrats à terme sur obligations canadiennes à 10 ans* | (0,0) |
| Contrats à très long terme sur obligations du Trésor américain de CME* | 0,0 |

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

| | |
|---|--------------------------|
| Valeur liquidative totale du Fonds | 669,0 millions \$ |
|---|--------------------------|

* Les valeurs du capital théorique représentent -1,0 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations canadiennes à 10 ans et -0,7 % des contrats à très long terme sur obligations du Trésor américain de CME.

** Les valeurs du capital théorique représentent 0,4 % de la valeur liquidative des options sur devises achetées.

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 31 décembre 2020 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.

