

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2019

Aperçu du portefeuille

Répartition du portefeuille	% de la valeur liquidative
Actions	63,9
Obligations	29,0
Obligations	29,0
Positions vendeur sur contrats à terme*	0,0
Options achetées**	0,0
Trésorerie et placements à court terme	5,4
Fonds communs de placement	1,1
Autres éléments d'actif (de passif)	0,3
Fonds/billets négociés en bourse	0,3

Répartition régionale	% de la valeur liquidative
Canada	58,9
États-Unis	26,7
Trésorerie et placements à court terme	5,4
Allemagne	3,2
Pays-Bas	2,9
Hong Kong	1,8
Autres éléments d'actif (de passif)	0,3
Australie	0,3
Royaume-Uni	0,3
Belgique	0,1
Nouvelle-Zélande	0,1

Répartition sectorielle	% de la valeur liquidative
Produits industriels	17,2
Obligations de sociétés	12,6
Services financiers	11,4
Technologie de l'information	10,9
Soins de santé	9,6
Obligations provinciales	6,3
Trésorerie et placements à court terme	5,4
Obligations fédérales	5,2
Consommation courante	3,7
Consommation discrétionnaire	3,4
Obligations d'État étrangères	3,3
Services de communication	3,1
Matières	2,9
Autres	2,1
Immobilier	1,3
Prêts à terme	1,3
Autres éléments d'actif (de passif)	0,3

Exposition nette aux devises	% de la valeur liquidative
Dollar canadien	79,9
Dollar américain	16,8
Dollar de Hong Kong	1,8
Euro	1,5

Les 25 principales positions acheteur

Émetteur	% de la valeur liquidative
Trésorerie et placements à court terme	5,4
Aon PLC	3,2
SAP AG	3,2
Québecor inc.	3,1
Wolters Kluwer NV	2,9
Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée	2,9
Banque Royale du Canada	2,9
CAE Inc.	2,9
Accenture PLC	2,7
Baxter International Inc.	2,7
Visa Inc.	2,5
Premium Brands Holdings Corp.	2,5
Automatic Data Processing Inc.	2,4
Stryker Corp.	2,2
Groupe TMX Ltée	2,2
Stella-Jones Inc.	2,1
Thermo Fisher Scientific Inc.	2,1
Morneau Shepell Inc.	1,9
Intact Corporation financière	1,8
ATS Automation Tooling Systems Inc.	1,8
Gouvernement du Canada 2,25 % 01-06-2029	1,8
Danaher Corp.	1,8
Techtronic Industries Co. Ltd.	1,8
Stantec Inc.	1,8
Spin Master Corp.	1,7

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	62,3
---	-------------

Les 25 principales positions vendeur

Émetteur	% de la valeur liquidative
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 **3,3 milliards \$**

* Les valeurs du capital théorique représentent -0,9 % de la valeur liquidative des contrats à très long terme sur obligations du Trésor américain de CME.

** Les valeurs du capital théorique représentent 1,6 % de la valeur liquidative des options achetées.

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 31 décembre 2019 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.

