

FONDS D'OBLIGATIONS DE BASE PLUS (PORTICO) CANADA VIE

(Auparavant Fonds d'obligations de base plus (Portico))

FONDS DE REVENU CANADIEN

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2020

Aperçu du portefeuille

Répartition du portefeuille	% de la valeur liquidative
Obligations	101,4
Obligations	97,5
Positions acheteur sur contrats à terme*	3,9
Positions vendeur sur contrats à terme**	0,0
Fonds/billets négociés en bourse	1,0
Autres éléments d'actif (de passif)	0,5
Trésorerie et placements à court terme	(2,9)

Répartition régionale	% de la valeur liquidative
Canada	98,3
États-Unis	2,6
Royaume-Uni	0,7
Australie	0,5
Autres éléments d'actif (de passif)	0,5
Allemagne	0,3
Trésorerie et placements à court terme	(2,9)

Répartition sectorielle	% de la valeur liquidative
Obligations de sociétés	49,9
Obligations provinciales	23,4
Obligations fédérales	18,4
Obligations municipales	4,5
Titres adossés à des créances hypothécaires	2,6
Obligations d'État étrangères	1,4
Obligations supranationales	1,2
Fonds/billets négociés en bourse	1,0
Autres éléments d'actif (de passif)	0,5
Trésorerie et placements à court terme	(2,9)

* Les valeurs du capital théorique représentent 3,9 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations canadiennes à 5 ans.

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

Les 25 principales positions acheteur

Émetteur	% de la valeur liquidative
Province de Québec 4,25 % 01-12-2043	2,8
Gouvernement du Canada 3,50 % 01-12-2045	2,8
Gouvernement du Canada 2,00 % 01-12-2051	2,0
Province de Québec 3,50 % 01-12-2048	1,9
Province de l'Ontario 4,70 % 02-06-2037	1,8
Province de l'Ontario 4,65 % 02-06-2041	1,7
Muskrat Falls 3,86 % 01-12-2048	1,6
Province de l'Ontario 2,65 % 02-12-2050	1,6
Gouvernement du Canada 1,50 % 01-06-2026	1,6
Fiducie du Canada pour l'habitation 2,40 % 15-12-2022	1,4
Province de la Nouvelle-Écosse 2,00 % 01-09-2030	1,4
Banque Royale du Canada 2,00 % 21-03-2022	1,3
Province de l'Ontario 2,05 % 02-06-2030	1,3
Inter Pipeline Ltd. 3,448 % 20-07-2020	1,3
Ville de Toronto 5,20 % 01-06-2040	1,3
Banque Royale du Canada, taux variable 23-12-2029, rachetables 2024	1,2
Suncor Énergie Inc. 3,10 % 26-11-2021, rachetables 2021	1,2
La Société Canadian Tire Ltée 2,65 % 06-07-2020	1,1
Scotia Capitaux Inc. 1,89 % 01-10-2024	1,1
Banque HSBC Canada 2,17 % 29-06-2022	1,0
Ville de Montréal 3,15 % 01-09-2028	1,0
Province du Manitoba 2,85 % 05-09-2046	1,0
Province de la Colombie-Britannique 3,20 % 18-06-2044	1,0
Trésorerie et placements à court terme	1,0
Gouvernement du Canada 1,00 % 01-09-2022	0,9

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **36,3**

Les 25 principales positions vendeur

Émetteur	% de la valeur liquidative
Contrats à terme sur obligations canadiennes à 10 ans**	0,0

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

Valeur liquidative totale du Fonds **1,6 milliard \$**

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