

FONDS EXEMPLAR D'INVESTMENT GRADE

Information trimestrielle sur le Portefeuille - Au 31 mars 2020

Répartition du portefeuille

Répartition	% de la valeur liquidative	
	Acheteur	Vendeur
Trésorerie et équivalents de trésorerie	30,8	(1,6)
Obligations de sociétés	68,4	-
Instruments dérivés	2,0	(1,7)
Énergie	0,2	-
Finance	1,6	-
Autres actifs (passifs)	0,3	-
Total	103,3	(3,3)

Notation ⁽¹⁾	% du total des titres de créance
	A
BBB	43,2
Moins de BBB	16,9
Non notés	12,3
Total	100,0

(1) Les notations sont fournies par Standard & Poor's, Moody's et/ou Dominion Bond Rating Service.

Les 25 principaux titres

Émetteur/Fonds sous-jacent	% de la valeur liquidative
Positions acheteur	
Trésorerie et équivalents de trésorerie	29,2
Merrill Lynch & Co. Inc., taux variable, remboursable par anticipation, 2,80%, 2022-05-30	10,7
Morgan Stanley, taux variable, remboursable par anticipation, 2,29%, 2023-02-03	8,6
Compagnie Crédit Ford du Canada, taux variable, 2,38%, 2020-09-21	7,7
Gibson Energy Inc., remboursable par anticipation, 5,25%, 2024-07-15	6,5
Sysco Canada Inc., remboursable par anticipation, 3,65%, 2025-04-25	5,3
Banque Laurentienne du Canada, taux variable, 1,58%, 2021-12-13	5,3
Banque de Montréal, taux variable, remboursable par anticipation, 4,338%, 2028-10-05	4,6
TRS R Preferred Basket P CDOR, 11 mars 2020, 1M	3,1
Coast Capital Savings Credit Union, taux variable, 2,59%, 2021-07-21	3,1
Goldman Sachs Group Inc. (The), taux variable, remb. par antic., 2,433%, 2023-04-26	3,0
Enbridge Inc., taux variable, remboursable par anticipation, 5,375%, 2077-09-27	2,6
Inter Pipeline Ltd., série 19-B, taux variable, remb. par antic., 6,625%, 2079-11-19	2,6
Molson Coors International L.P., remboursable par anticipation, 2,84%, 2023-07-15	2,4
Banque Canadienne Impériale de Commerce, 2,25%, 2025-01-28	2,0
Brookfield Property Finance ULC, 4,115%, 2021-10-19	1,6
La Banque de Nouvelle-Écosse, priv., série 32, taux variable, conv., perp.	1,4
TELUS Corp., série CO, remboursable par anticipation, 3,2%, 2021-04-05	1,3
Compagnie Crédit Ford du Canada, taux variable, 5,10%, 2022-01-10	0,7
Molson Coors International L.P., série 2, remb. par antic., 2,75%, 2020-09-18	0,6
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	102,3
Positions vendeur	
TRS R Bond Basket P CDOR, 11 mars 2020, 1M+25PDB	(1,2)
Contrats à terme normalisés sur obligations canadiennes à 10 ans	(0,6)
Contrats à terme normalisés sur obligations à 5 ans du Canada	(0,3)
CDOR à 3 mois, 1 sept. 2023, 1,715%	(0,3)
Contrats à terme normalisés sur obligations à 5 ans du Trésor des États-Unis	(0,2)
Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	(2,6)
Total (%)	99,7
Total de la valeur liquidative (en millions \$)	154,4

"Les placements et les pourcentages peuvent changer en raison des transactions suite à la gestion continue du portefeuille. Les mises à jour trimestrielles sont disponibles sur le site www.arrow-capital.com 60 jours suivant la fin du trimestre, sauf pour le trimestre se terminant le 31 décembre où elles sont disponibles dans les 90 jours.