

# Fonds alternatif à revenu fixe YTM Capital

INFORMATION TRIMESTRIELLE SUR LE PORTEFEUILLE

En date du 30 novembre 2023

## Composition du portefeuille

Répartition sectorielle	% de la valeur liquidative		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Net
Finance	233,3 %	-	233,3 %
Biens de consommation cyclique	61,6 %	-	61,6 %
Énergie	32,7 %	-	32,7 %
Services aux collectivités	25,4 %	-	25,4 %
Communications	21,2 %	-	21,2 %
Industriel	10,9 %	-	10,9 %
Biens de consommation non cyclique	5,3 %	-	5,3 %
Gouvernement	-	(271,9 %)	(271,9 %)
Diversifié	2,8 %	(0,3 %)	2,5 %
Espèces	0,0 %	(21,0 %)	(21,0 %)
<b>Pourcentage total</b>	<b>393,3 %</b>	<b>(293,3 %)</b>	<b>100,0 %</b>

Répartition par échéance	% de la valeur liquidative		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Net
De 0 à 1 an	156,1 %	(63,4 %)	92,7 %
De 1 à 2 ans	116,4 %	(103,1 %)	13,3 %
De 2 à 3 ans	40,9 %	(37,7 %)	3,2 %
De 3 à 5 ans	57,2 %	(47,2 %)	10,0 %
De 5 à 10 ans	20,2 %	(17,5 %)	2,7 %
10 ans et plus	2,5 %	(3,4 %)	(0,9 %)
<b>Pourcentage total</b>	<b>393,3 %</b>	<b>(293,3 %)</b>	<b>100,0 %</b>

Répartition par notation	% de la valeur liquidative		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Net
AAA	-	(271,9 %)	(271,9 %)
AA	36,0 %	-	36,0 %
A	106,8 %	-	106,8 %
BBB	247,6 %	(0,3 %)	247,3 %
BB	0,9 %	-	0,9 %
Espèces	0,0 %	(21,0 %)	(21,0 %)
<b>Pourcentage total</b>	<b>393,3 %</b>	<b>(293,3 %)</b>	<b>100,0 %</b>

Valeur liquidative totale 118 140 712\$

## 25 principaux placements, positions acheteur

Émetteurs	% de la valeur liquidative
Royal Bank of Canada	19,5 %
Bank of Montreal	19,1 %
Bank of Nova Scotia	18,6 %
Daimler Truck Canada	18,1 %
Toronto-Dominion Bank	18,0 %
Nova Scotia Power	17,0 %
Goldman Sachs	13,2 %
Manulife	11,4 %
CIBC	11,1 %
Suncor Energy Inc	9,9 %
First Cap Real Estate	8,9 %
Toyota Credit Canada	8,4 %
National Bank of Canada	8,2 %
TransCanada Pipelines Ltd.	7,6 %
Choice Properties REIT	7,4 %
Bank of America	7,3 %
Fairfax Financial Holdings Ltd.	6,4 %
CNH Industrial Capital	6,0 %
BCIMC Realty Corp	5,9 %
BMW Finance Canada	5,7 %
Fed Caisses Desjardins	5,4 %
RioCan REIT	5,4 %
Wells Fargo and Company	5,2 %
Mastercard Credit Trust	5,0 %
Alimentation Couche-Tard	5,0 %

**Pourcentage total de la valeur liquidative représenté par les placements 253,8 %**

## Total des placements, positions vendeur

Émetteurs	% de la valeur liquidative
CDX	(0,3 %)
Titres de créance du gouvernement du Canada	(271,9 %)

**Pourcentage total de la valeur liquidative représenté par les placements (272,2 %)**

Les placements et les pourcentages ont changé depuis le 30 novembre 2023 en raison des opérations de portefeuille continues réalisées par le Fonds. Les mises à jour trimestrielles sur les participations sont disponibles dans les 60 jours suivant la fin d'un trimestre, sauf pour le trimestre terminé le 28/29 février, soit la fin de l'exercice du Fonds, dont la mise à jour sera disponible dans les 90 jours suivants. Veuillez consulter le site Internet de YTM Capital, à l'adresse ytmcapital.com, et le site Internet de SEDAR, à l'adresse sedar.com, pour obtenir les derniers renseignements.