

Fonds alternatif à revenu fixe YTM Capital

INFORMATION TRIMESTRIELLE SUR LE PORTEFEUILLE

En date du 30 septembre 2021

Composition du portefeuille

Répartition sectorielle	% de la valeur liquidative		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Net
Finance	222,1 %	-	222,1 %
Énergie	62,2 %	-	62,2 %
Biens de consommation cyclique	24,6 %	-	24,6 %
Communications	21,3 %	-	21,3 %
Biens de consommation non cyclique	20,1 %	-	20,1 %
Services aux collectivités	5,7 %	-	5,7 %
Gouvernement	-	(268,4 %)	(268,4 %)
Pourcentage total	368,3 %	(268,4 %)	99,9 %

Répartition par échéance	% de la valeur liquidative		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Net
De 0 à 1 an	82,3 %	(65,2 %)	17,1 %
De 1 à 2 ans	72,6 %	(47,0 %)	25,7 %
De 2 à 3 ans	67,8 %	(46,7 %)	21,1 %
De 3 à 5 ans	79,9 %	(57,7 %)	22,0 %
De 5 à 10 ans	51,7 %	(44,4 %)	7,4 %
10 ans et plus	4,6 %	(7,6 %)	(3,0 %)
Pourcentage total	368,3 %	(268,4 %)	99,9 %

Répartition par notation	% de la valeur liquidative		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Net
AAA	4,0 %	(268,4 %)	(264,4%)
AA	35,0 %	-	35,0 %
A	78,4 %	-	78,4 %
BBB	230,3 %	(0,2 %)	230,3%
BB	20,3 %	-	20,3 %
Pourcentage total	368,0,8 %	(268,4%)	99,5 %

Valeur liquidative totale 49 179 770 \$

25 principaux placements, positions acheteur

Émetteurs	% de la valeur liquidative
Toronto-Dominion Bank	19,6%
CIBC	19,6%
Enbridge	19,2%
Royal Bank of Canada	14,8%
Bruce Power LP	12,3%
Pembina Pipeline Corp	11,8%
Equitable Bank	11,3%
Goldman Sachs	10,0%
TransCanada Pipelines Ltd.	10,0%
National Bank	8,7%
Central 1 Credit Union	8,7%
Canadian Western Bank	8,5%
Coast Capital Savings Credit Union	8,2%
GE Capital Canada Fundco	7,8%
MCAP Commercial LP	7,6%
Canadian Natural Resources	7,6%
Ford Credit Company Canada	6,9%
Caisse Central Desjardins	6,8%
Dream Industrial REIT	6,8%
Bank of Montreal	6,6%
Vancouver City Savings Credit Union	6,4%
Concentra Bank	6,3%
Honda Canada Finance	6,0%
Ternanet Holdings LP	6,0%
BCE Inc.	5,7%

Pourcentage total de la valeur liquidative représenté par les placements 243,1%

Total des placements, positions vendeur

Émetteurs	% de la valeur liquidative
Titres de créance du gouvernement du Canada	(268,4 %)

Pourcentage total de la valeur liquidative représenté par les placements (268,4%)

Les placements et les pourcentages ont changé depuis le 30 septembre 2021 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 31 décembre, 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.