

Fonds alternatif à revenu fixe YTM Capital

INFORMATION TRIMESTRIELLE SUR LE PORTEFEUILLE

En date du 31 mai 2022

Composition du portefeuille

Répartition sectorielle	% de la valeur liquidative		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Net
Finance	255,9 %	-	255,9 %
Énergie	43,1 %	-	43,1 %
Biens de consommation cyclique	22,2 %	-	22,2 %
Industriel	14,9 %	-	14,9 %
Communications	12,6 %	-	12,6 %
Biens de consommation non cyclique	11,3 %	-	11,3 %
Services aux collectivités	3,9 %	-	3,9 %
Technologie	0,7 %	-	0,7 %
Gouvernement	-	(294,7 %)	(294,7 %)
Pourcentage total	364,7 %	(294,7 %)	70,0 %

Répartition par échéance	% de la valeur liquidative		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Net
De 0 à 1 an	34,6 %	(0,9 %)	33,7 %
De 1 à 2 ans	69,5 %	(57,6 %)	11,9 %
De 2 à 3 ans	99,4 %	(82,5 %)	16,9 %
De 3 à 5 ans	104,1 %	(95,3 %)	8,8 %
De 5 à 10 ans	52,8 %	(49,1 %)	3,7 %
10 ans et plus	4,3 %	(9,2 %)	(4,9 %)
Pourcentage total	368,3 %	(268,4 %)	99,9 %

Répartition par notation	% de la valeur liquidative		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Net
AAA	10,4 %	(294,7 %)	(284,3%)
AA	47,6 %	-	47,6 %
A	118,5 %	-	118,5 %
BBB	186,1 %	-	186,1 %
BB	2,0 %	-	2,0 %
Pourcentage total	364,7 %	(294,7%)	70,0 %

25 principaux placements, positions acheteur

Émetteurs	% de la valeur liquidative
Enbridge	18,7 %
Scotiabank	18,5 %
Bank of Montreal	17,6 %
Toronto-Dominion Bank	17,3 %
Royal Bank of Canada	15,3 %
Coast Capital Savings Credit Union	14,9 %
TransCanada Pipelines Ltd.	13,7 %
Goldman Sachs	12,2 %
Mastercard Trust	11,6 %
Fortified Trust	11,2 %
CIBC	10,3 %
Canadian Western Bank	9,6 %
Equitable Bank	9,3 %
Artis REIT	7,8 %
Riocan REIT	7,3 %
Caisse Central Desjardins	7,3 %
Rogers	7,0 %
MCAP Commercial LP	6,7 %
Dream Industrial REIT	6,6 %
CARDS II Trust	6,4 %
Vancouver City Savings Credit Union	6,2 %
Morgan Stanley	6,0 %
Concentra Credit Union	5,8 %
Honda Canada Finance	5,8 %
General Motors of Canada Finance	5,6 %

Pourcentage total de la valeur liquidative représenté par les placements **258,9 %**

Total des placements, positions vendeur

Émetteurs	% de la valeur liquidative
Titres de créance du gouvernement du Canada	(294,7 %)

Pourcentage total de la valeur liquidative représenté par les placements **(294,7 %)**

Valeur liquidative totale 50 739 839\$

Les placements et les pourcentages ont changé depuis le 31 mai 2022 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 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.