

Fonds alternatif à revenu fixe YTM Capital

INFORMATION TRIMESTRIELLE SUR LE PORTEFEUILLE

En date du 31 mai 2023

Composition du portefeuille

Répartition sectorielle	% de la valeur liquidative		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Net
Finance	214,8 %	-	214,8 %
Biens de consommation cyclique	36,9 %	-	36,9 %
Communications	30,2 %	-	30,2 %
Énergie	26,5 %	-	26,5 %
Services aux collectivités	3,9 %	-	3,9 %
Industriel	3,4 %	-	3,4 %
Biens de consommation non cyclique	3,2 %	-	3,2 %
Technologie	0,4 %	-	0,4 %
Gouvernement	-	(219,5 %)	(219,5 %)
Pourcentage total	319,3 %	(219,5 %)	99,8 %

Répartition par échéance	% de la valeur liquidative		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Net
De 0 à 1 an	121,5 %	(43,1 %)	78,4 %
De 1 à 2 ans	112,1 %	(86,7 %)	25,3 %
De 2 à 3 ans	29,8 %	(30,0 %)	(0,2 %)
De 3 à 5 ans	38,9 %	(42,2 %)	(3,3 %)
De 5 à 10 ans	16,6 %	(15,6 %)	1,0 %
10 ans et plus	0,0 %	(1,8 %)	(1,8 %)
Pourcentage total	319,3 %	(219,5 %)	99,8 %

Répartition par notation	% de la valeur liquidative		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Net
AAA	2,3 %	(219,5 %)	(217,2 %)
AA	8,1 %	-	8,1 %
A	103,6 %	-	103,6 %
BBB	198,3 %	-	198,3 %
BB	7,0 %	-	7,0 %
Pourcentage total	319,3 %	(219,5 %)	99,8 %

Valeur liquidative totale

84 985 747\$

25 principaux placements, positions acheteur

Émetteurs	% de la valeur liquidative
Bank of Montreal	19,4 %
CIBC	15,7 %
Royal Bank of Canada	15,3 %
Toronto-Dominion Bank	14,8 %
Goldman Sachs	14,3 %
Scotiabank	14,3 %
Dream Industrial REIT	13,3 %
Daimler Truck Finance Canada	12,1 %
Coast Capital Savings Credit Union	12,0 %
Rogers	11,8 %
Morgan Stanley	9,4 %
Artis REIT	9,0 %
National Bank	7,1 %
First Capital REIT	7,0 %
Mastercard Trust	6,9 %
General Motors of Canada Finance	6,3 %
Industrial Alliance	5,9 %
Ford Canada Credit	5,8 %
Inter Pipelines Ltd.	5,6 %
TransCanada Pipelines	5,6 %
AT&T	5,5 %
Northwest Redwater Partnership	5,1 %
Cenovus Energy Inc.	5,0 %
Honda Canada Finance	4,7 %
VW Canada Finance	4,6 %

Pourcentage total de la valeur liquidative représenté par les placements **319,3 %**

Total des placements, positions vendeur

Émetteurs	% de la valeur liquidative
Titres de créance du gouvernement du Canada	(202,7 %)
U.S Treasuries	(16,8 %)
CDX	(0,3 %)

Pourcentage total de la valeur liquidative représenté par les placements **(219,8 %)**

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