Fonds alternatif à revenu fixe YTM Capital

INFORMATION TRIMESTRIELLE SUR LE PORTEFEUILLE

En date du 30 septembre 2020

Composition du portefeuille

Répartition sectorielle	% de la valeur liquidative		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Net
Finance	165,1 %	-	165,1 %
Énergie	40,6 %	-	40,6 %
Biens de consommation cyclique	14,4 %	-	14,4 %
Gouvernement	13,2 %	(150,6 %)	(137,4 %)
Biens de consommation non cyclique	8,6 %	-	8,6 %
Services aux collectivités	7,3 %	-	7,3 %
Communications	1,6 %	(1,2 %)	0,4 %
Pourcentage total	**250,8 %**	**(151,8 %)**	**99,1 %**

Répartition par échéance	% de la valeur liquidative		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Net
De 0 à 1 an	141,0 %	(70,7 %)	70,3 %
De 1 à 2 ans	57,8 %	(41,5 %)	16,2 %
De 2 à 3 ans	29,2 %	(17,7 %)	11,5 %
De 3 à 5 ans	15,5 %	(18,7 %)	(3,1 %)
De 5 à 10 ans	6,4 %	(2,0 %)	4,4 %
10 ans et plus	0,9 %	(1,2 %)	(0,2 %)
Pourcentage total	**250,8 %**	**(151,8 %)**	**99,1 %**

Répartition par notation	% de la valeur liquidative		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Net
AAA	15,6 %	(150,6 %)	(135,0 %)
AA	3,8 %	-	3,8 %
A	48,1 %	-	48,1 %
BBB	182,1 %	(0,2 %)	180,9 %
BB	1,3 %	-	1,3 %
Pourcentage total	**250,8 %**	**(151,8 %)**	**99,1 %**

Valeur liquidative totale	**40 344 661 $**

25 principaux placements, positions acheteur

Émetteurs	% de la valeur liquidative
Toronto-Dominion Bank	18,8 %
Enbridge	17,6 %
Bank of Nova Scotia	17,1 %
Artis REIT	16,4 %
Equitable Bank	12,6 %
Morgan Stanley	11,7 %
Pembina Pipeline Corp	11,5 %
Morguard Corporation	10,0 %
Bank of Montreal	7,7 %
MCAP Commercial LP	7,1 %
Bank of America	7,1 %
VW Credit Canada Inc.	6,7 %
Manulife FInancial	6,5 %
Laurentian Bank of Canada	6,1 %
Dollarama Inc.	5,7 %
Bruce Power	5,5 %
Transcanada Pipelines Ltd.	5,1 %
Smart REIT	5,1 %
Concentra Bank	4,2 %
Royal Bank of Canada	4,2 %
Coast Capital Savings Credit Union	4,2 %
Inter Pipeline Ltd.	3,4 %
Molson Coors International LP	3,3 %
Ternanet Holdings LP	3,3 %
Wells Fargo & Co.	3,3 %
Pourcentage total de la valeur liquidative représenté par les placements	**204,1 %**

Total des placements, positions vendeur

Émetteurs	% de la valeur liquidative
Titres de créance du gouvernement du Canada	(150,6 %)
Bell Canada	(1,2 %)
Pourcentage total de la valeur liquidative représenté par les placements	**(151,8 %)**

Les placements et les pourcentages ont changé depuis le 30 septembre 2020 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.

YTM | CAPITAL