

Fonds alternatif à revenu fixe YTM Capital

INFORMATION TRIMESTRIELLE SUR LE PORTEFEUILLE

En date du 31 mars 2020

Composition du portefeuille

Répartition sectorielle	% de la valeur liquidative		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Net
Finance	134,2 %	(12,4 %)	121,8 %
Biens de consommation non cyclique	43,5 %	-	43,5 %
Énergie	37,6 %	-	37,6 %
Biens de consommation cyclique	26,3 %	-	26,3 %
Gouvernement	12,1 %	(157,6 %)	(145,5 %)
Services aux collectivités	4,5 %	-	4,5 %
Industrie	2,3 %	-	2,3 %
Communications	1,9 %	-	1,9 %
Pourcentage total	262,4 %	(169,9 %)	92,4 %

Répartition par échéance	% de la valeur liquidative		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Net
De 0 à 1 an	116,9 %	(84,9 %)	32,0 %
De 1 à 2 ans	77,9 %	(23,5 %)	54,4 %
De 2 à 3 ans	27,9 %	(22,8 %)	5,2 %
De 3 à 5 ans	35,2 %	(33,8 %)	1,4 %
De 5 à 10 ans	4,0 %	(4,5 %)	(0,5 %)
10 ans et plus	0,4 %	(0,4 %)	0,0 %
Pourcentage total	262,4 %	(169,9 %)	92,4 %

Répartition par notation	% de la valeur liquidative		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Net
AAA	15,7 %	(157,6 %)	(141,9 %)
AA	9,9 %	(1,7 %)	8,2 %
A	59,6 %	(10,7 %)	48,9 %
BBB	147,4 %	-	147,4 %
BB	29,8 %	-	29,8 %
Pourcentage total	262,4 %	(169,9 %)	92,4 %

Valeur liquidative totale 23 629 018,62 \$

25 principaux placements, positions acheteur

Émetteurs	% de la valeur liquidative
Enbridge	21,2 %
Morgan Stanley	19,7 %
Toronto-Dominion Bank	19,6 %
Kraft Heinz Foods	17,6 %
Equitable Bank	14,8 %
Smart Centres REIT	12,2 %
Ford Credit Canada	12,2 %
Ternanet Holdings LP	11,8 %
Molson Coors International LP	11,6 %
Laurentian Bank of Canada	10,4 %
Dollarama Inc,	9,7 %
Transcanada Pipelines Ltd, Residual Strip	8,5 %
Coast Capital Savings Credit Union	7,1 %
Concentra Bank	7,0 %
Brookfield Property Finance ULC	6,1 %
Fortified Trust	5,3 %
Bank of America	5,3 %
AltaGas Ltd	4,8 %
Vancouver City Savings Credit Union	3,8 %
Pembina Pipeline Corp	3,6 %
VW Credit Canada Inc,	3,5 %
MCAP Commercial LP	3,3 %
ENMAX Corp,	3,0 %
Morguard Corp	2,8 %
First National Financial Corp	2,5 %

Pourcentage total de la valeur liquidative représenté par les placements 227,3 %

Total des placements, positions vendeur

Émetteurs	% de la valeur liquidative
Titres de créance du gouvernement du Canada	(157,6 %)
Royal Bank of Canada	(10,7 %)
Bank of Nova Scotia	(0,8 %)
CIBC	(0,8 %)

Pourcentage total de la valeur liquidative représenté par les placements (169,9 %)

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