

Fonds alternatif à revenu fixe YTM Capital

Information trimestrielle sur le portefeuille

En date du 30 septembre 2019

Répartition du portefeuille par secteur

Services financiers	142,7%
Biens de consommation, cycliques	43,7%
Biens de consommation, non cycliques	38,8%
Produits industriels	30,1%
Énergie	23,9%
Services publics	2,1%
Total des placements en positions acheteur	281,3%
Titres de créance du gouvernement du Canada	-188,7%
Liquidités	-2,0%
Total des placements en positions vendeur	-190,7%

Répartition des notes des titres du portefeuille

AAA	0,9%
AA	6,4%
AA	95,9%
BBB	178,1%
Total des placements en positions acheteur	281,3%

Répartition des échéances des titres du portefeuille

de 0 à 1 an	91,7%
de 1 à 2 ans	70,7%
de 2 à 3 ans	50,2%
de 3 à 5 ans	50,9%
de 5 à 10 ans	15,4%
10 ans et plus	2,4%
Total des placements en positions acheteur	281,3%

25 principaux titres en positions acheteur

Enbridge Inc	19,0%
Sun Life Financial Inc.	18,3%
Morgan Stanley	18,0%
Equitable Bank	17,9%
SmartCentres Real Estate Investment Trust	17,5%
Teranet Holdings LP	16,8%
Molson Coors Brewing Company	16,5%
Enercare Solutions Inc.	13,9%
Ford Motor Co.	13,8%
Dollarama Inc	13,8%
John Deere Financial Inc.	13,4%
Laurentian Bank	12,6%
Volkswagen	12,5%
Bank of Montreal	10,4%
Brookfield Property Partners	8,8%
Toronto Dominion Bank	8,8%
Coast Capital Savings Credit Union	8,4%
Bank of Nova Scotia	7,8%
CIBC	4,0%
Pembina Pipeline Corporation	3,6%
Reliance LP	3,1%
Royal Bank of Canada	3,1%
Penske Truck Leasing Canada	2,4%
National Bank of Canada	2,1%
Industrial Alliance Insurance and Financial Services Inc.	1,8%

Principales positions acheteur, en pourcentage de la valeur liquidative totale 247,5%

25 principaux titres en positions vendeur

Titres de créance du gouvernement du Canada	-175,2%
Cash	-2,1%

Principales positions vendeur, en pourcentage de la valeur liquidative totale -177,3%

Valeur liquidative totale du Fonds 16,759,275 \$

Les placements et les pourcentages ont changé depuis le 30 septembre 2019 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.