

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2023

Aperçu du portefeuille

RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	101,9
Obligations	53,1
Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)*	49,3
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)*	(0,5)
Options achetées**	–
Options vendues**	–
Autres éléments d'actif (de passif)	2,6
Trésorerie et équivalents de trésorerie	(4,5)

RÉPARTITION RÉGIONALE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
États-Unis	43,2
Royaume-Uni	24,3
Japon	5,0
Îles Caïmans	4,9
Autre	4,3
Allemagne	3,5
Danemark	3,4
Canada	2,7
Autres éléments d'actif (de passif)	2,6
Corée du Sud	2,6
Irlande	2,3
France	1,9
Israël	1,0
Pays-Bas	1,0
Australie	0,9
Suisse	0,9
Trésorerie et équivalents de trésorerie	(4,5)

RÉPARTITION SECTORIELLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations d'État étrangères	67,0
Obligations de sociétés	17,9
Titres adossés à des créances hypothécaires	15,4
Autres éléments d'actif (de passif)	2,6
Obligations fédérales	1,6
Trésorerie et équivalents de trésorerie	(4,5)

OBLIGATIONS PAR NOTE DE CRÉDIT [†]	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
AAA	13,7
AA	9,1
A	6,2
BBB	6,3
Inférieure à BBB	3,5
Sans note	14,3

* Les valeurs théoriques représentent 49,3 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur) et –52,4 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur).

** Les valeurs théoriques représentent 0,0 % de la valeur liquidative des options achetées et –0,0 % de la valeur liquidative des options vendues.

† Les notes de crédit et les catégories de crédit sont basées sur les notes d'une agence de notation désignée.

FONDS EN GESTION COMMUNE D'OBLIGATIONS MONDIALES PIMCO – IG

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 31 décembre 2023

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS ACHETEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur	
Trésorerie et équivalents de trésorerie	20,1
Gouvernement du Canada, bon du Trésor 24-03-2024	9,9
Gouvernement du Canada, bon du Trésor 18-01-2024	6,9
Gouvernement du Canada, bon du Trésor 29-02-2024	2,7
Gouvernement du Japon 0,01 % 01-05-2024	2,1
Bons du Trésor à escompte du Japon 09-01-2024	1,9
Obligations du Trésor des États-Unis 02-01-2024	1,4
Obligations du Trésor de la Corée 1,38 % 10-12-2029	1,4
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,50 % 15-01-2028	0,9
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,25 % 15-01-2025	0,9
Gouvernement d'Israël 5,00 % 30-10-2026	0,9
Realkredit Danmark AS 1,00 % 01-01-2024	0,8
Obligations du Trésor des États-Unis 1,38 % 15-11-2040	0,8
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 1,13 % 15-01-2033	0,8
Obligations du Trésor des États-Unis 0,75 % 31-01-2028	0,7
Gouvernement du Canada 3,25 % 01-12-2033	0,7
Gouvernement du Japon 1,50 % 20-09-2043	0,6
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-04-2025	0,6
Realkredit Danmark AS 1,00 % 01-04-2024	0,5
Gouvernement du Japon 0,10 % 10-03-2028	0,5
Nykredit Realkredit AS 1,50 % 01-10-2053, rachetables	0,5
Obligations du Trésor des États-Unis 1,88 % 15-02-2041	0,5
RIPON Mortgages PLC 1X, taux variable 28-08-2056	0,5
Obligations du Trésor des États-Unis 11-01-2024	0,5
HAYEM 12A A 0,00 % 25-01-2037	0,5
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	57,6

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS VENDEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur	
Contrat à terme standardisé sur obligations du Royaume-Uni (ICE)	(0,2)
Contrat à terme standardisé SOFR de CME à 3 mois	(0,1)
Contrat à terme standardisé à très long terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans de CME	(0,1)
Contrat à terme standardisé sur des obligations du Trésor ASX à 10 ans (SFE)	(0,1)
Contrat à terme standardisé sur des obligations Euro-Schatz (EUX)	–
Contrat à terme standardisé sur des obligations EURIBOR (EUX) à 3 mois	–
Contrat à terme standardisé sur des obligations du gouvernement du Japon à 10 ans (SGX Mini)	–
Contrat à terme standardisé sur des obligations Euro-BOBL (EUX)	–
Contrat à terme standardisé sur des obligations du Trésor américain à 10 ans (CBOT)	–
Contrat à terme standardisé sur des obligations Euro-BUXL à 30 ans (EUX)	–
Contrat à terme standardisé sur des obligations du Trésor ASX à 3 ans (SFE)	–
Option de swap de taux d'intérêt, hors cote, option d'achat souscrite @ 4,00 \$ éch. 05-01-2024	–
Option de swap de taux d'intérêt, hors cote, option de vente souscrite @ 3,00 \$ éch. 05-01-2024	–
Option de swap de taux d'intérêt, hors cote, option d'achat souscrite @ 3,00 \$ éch. 05-01-2024	–
Option de swap de taux d'intérêt, hors cote, option de vente souscrite @ 4,00 \$ éch. 05-01-2024	–
Option de swap de taux d'intérêt, hors cote, option de vente souscrite @ 4,00 \$ éch. 17-01-2024	–
Option de swap de taux d'intérêt, hors cote, option d'achat souscrite @ 3,00 \$ éch. 17-01-2024	–
Option de swap de taux d'intérêt, hors cote, option d'achat souscrite @ 2,00 \$ éch. 19-01-2024	–
Option de swap de taux d'intérêt, hors cote, option de vente souscrite @ 3,00 \$ éch. 19-01-2024	–
Option de swap de taux d'intérêt, hors cote, option de vente souscrite @ 4,00 \$ éch. 19-01-2024	–
Option de swap de taux d'intérêt, hors cote, option d'achat souscrite @ 3,00 \$ éch. 19-01-2024	–
Option de swap de taux d'intérêt, hors cote, option de vente souscrite @ 4,00 \$ éch. 23-01-2024	–
Option de swap de taux d'intérêt, hors cote, option d'achat souscrite @ 3,00 \$ éch. 23-01-2024	–
Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	(0,5)

Valeur liquidative totale du Fonds

1,2 milliard \$

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 31 décembre 2023 en raison des opérations de portefeuille continues du Fonds. Les mises à jour trimestrielles des titres sont disponibles dans les 60 jours suivant la fin de chaque trimestre, sauf pour le trimestre se terminant le 31 mars, date de clôture de l'exercice du Fonds, où elles sont disponibles dans les 90 jours.