

FONDS D'OBLIGATIONS MONDIALES IG PIMCO

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2023

Aperçu du portefeuille du Fonds sous-jacent*

| 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 |

* Le Fonds est actuellement entièrement investi dans le Fonds en gestion commune d'obligations mondiales PIMCO – IG (le « Fonds sous-jacent »). Pour le prospectus et d'autres renseignements concernant le Fonds sous-jacent, veuillez consulter les adresses suivantes : www.ig.ca/fr ou www.sedarplus.ca.

** 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 D'OBLIGATIONS MONDIALES IG PIMCO

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 31 décembre 2023

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS

ACHETEUR DU FONDS SOUS-JACENT* % 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 DU FONDS SOUS-JACENT* % 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 | — |
| Optilon 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

24,2 millions \$

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 31 décembre 2023 en raison des opérations de portefeuille continues du Fonds et du Fonds sous-jacent. 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.