

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2024

Aperçu du portefeuille

RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	77,9
Obligations	54,7
Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)*	23,2
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)*	–
Options achetées**	–
Options vendues**	–
Placements à court terme	20,2
Autres éléments d'actif (de passif)	1,2
Swaps†	0,4
Trésorerie et équivalents de trésorerie	0,3

RÉPARTITION RÉGIONALE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
États-Unis	34,9
Canada	23,0
Royaume-Uni	6,7
Autre	5,9
Japon	4,8
Îles Caïmans	4,3
Allemagne	3,8
France	3,1
Italie	3,1
Irlande	2,5
Corée du Sud	2,3
Autres éléments d'actif (de passif)	1,2
Suisse	1,2
Israël	1,1
Pays-Bas	1,0
Roumanie	0,8
Trésorerie et équivalents de trésorerie	0,3

RÉPARTITION SECTORIELLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations d'État étrangères	39,6
Obligations de sociétés	20,6
Billets à escompte fédéraux à court terme	18,3
Titres adossés à des créances hypothécaires	14,6
Billets à escompte de gouvernements étrangers à court terme	1,9
Obligations fédérales	1,7
Gouvernements provinciaux	1,4
Autres éléments d'actif (de passif)	1,2
Autre	0,4
Trésorerie et équivalents de trésorerie	0,3

OBLIGATIONS PAR NOTE DE CRÉDIT††	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
AAA	14,0
AA	9,2
A	10,6
BBB	9,8
Inférieure à BBB	2,6
Sans note	8,5

* Les valeurs théoriques représentent 23,2 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur) et –34,8 % 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 valeurs théoriques représentent 196,9 % de la valeur liquidative des swaps.

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

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 30 juin 2024

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS ACHETEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur	
Gouvernement du Canada, bon du Trésor 29-08-2024	15,7
Bons du Trésor à escompte du Japon 22-07-2024	4,5
Bons du Trésor à escompte du Japon 01-07-2024	4,4
Bons du Trésor à escompte du Japon 08-07-2024	4,0
Bons du Trésor à escompte du Japon 05-08-2024	3,9
Bons du Trésor à escompte du Japon 29-07-2024	1,9
Gouvernement du Canada, bon du Trésor 26-09-2024	1,7
Bons du Trésor à escompte du Japon 20-06-2025	1,4
Trésorerie et équivalents de trésorerie	1,4
Bons du Trésor à escompte du Japon 13-08-2024	1,4
Bons du Trésor à escompte du Japon 16-07-2024	1,3
Obligations du Trésor de la Corée 1,38 % 10-12-2029	1,2
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	0,8
Gouvernement du Canada, bon du Trésor 12-09-2024	0,8
Gouvernement d'Israël 5,00 % 30-10-2026	0,8
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 1,13 % 15-01-2033	0,8
Gouvernement du Japon, obligation à 30 ans, 1,80 % 20-03-2054	0,8
Obligations du Trésor des États-Unis 1,38 % 15-11-2040	0,7
Obligations du Trésor des États-Unis 4,75 % 15-11-2043	0,7
Obligations du Trésor des États-Unis 30-07-2024	0,6
Province de Québec 3,60 % 01-09-2033	0,6
Gouvernement du Canada 3,50 % 01-03-2034	0,6
Gouvernement de Singapour 3,25 % 01-06-2054	0,6
Gouvernement du Japon 1,50 % 20-09-2043	0,5
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	52,0

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS VENDEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur	
Contrat à terme standardisé sur obligations du Trésor américain à long terme (CBOT)	—
Contrat à terme standardisé sur des obligations du Trésor américain à 5 ans (CBOT)	—
Contrat à terme standardisé SOFR de CME à 3 mois 17-12-2024	—
Contrat à terme standardisé SOFR de CME à 3 mois 17-06-2025	—
Contrat à terme standardisé SOFR de CME à 3 mois 16-12-2025	—
Contrats à terme standardisés sur obligations Euro-Schatz	—
Contrat à terme standardisé sur des obligations Euro-BOBL (EUX)	—
Contrat à terme standardisé sur des obligations Euro-BUXL à 30 ans (EUX)	—
Contrat à terme standardisé sur obligations du Royaume-Uni (ICE)	—
Contrat à terme standardisé sur des obligations du Trésor ASX à 10 ans (SFE)	—
Contrat à terme standardisé sur des obligations du gouvernement du Japon à 10 ans (SGX Mini)	—
Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	—
Valeur liquidative totale du Fonds	1,3 milliard \$

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 30 juin 2024 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.