

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2023

Aperçu du portefeuille

RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	57,4
<i>Obligations</i>	48,9
<i>Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)*</i>	8,3
<i>Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)*</i>	0,2
<i>Options achetées**</i>	–
<i>Options vendues**</i>	–
Placements à court terme	28,4
Trésorerie et équivalents de trésorerie	11,8
Autres éléments d'actif (de passif)	2,4
Swaps†	–

RÉPARTITION RÉGIONALE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
États-Unis	26,1
Japon	26,0
Trésorerie et équivalents de trésorerie	11,8
France	7,4
Îles Caïmans	6,4
Royaume-Uni	5,0
Danemark	4,4
Autre	3,6
Autres éléments d'actif (de passif)	2,4
Canada	1,4
Irlande	0,9
Australie	0,9
Suisse	0,8
Allemagne	0,8
Israël	0,7
Arabie saoudite	0,7
Roumanie	0,7

RÉPARTITION SECTORIELLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Billets fédéraux à court terme	27,5
Obligations d'État étrangères	24,8
Obligations de sociétés	16,9
Titres adossés à des créances hypothécaires	15,6
Trésorerie et équivalents de trésorerie	11,8
Autres éléments d'actif (de passif)	2,4
Papier commercial de sociétés	0,9
Obligations fédérales	0,1

* Les valeurs théoriques représentent 8,3 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur) et –30,8 % 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 137,5 % de la valeur liquidative des swaps.

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 30 juin 2023

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS ACHETEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur	
Trésorerie et équivalents de trésorerie	20,1
Gouvernement du Japon 0 % 31-07-2023	6,1
Gouvernement du Japon 0 % 21-08-2023	4,3
Gouvernement de la France 0 % 19-07-2023	4,2
Gouvernement du Japon 0 % 28-08-2023	3,6
Gouvernement du Japon 0,01 % 01-05-2024	2,3
Gouvernement de la France 0 % 05-07-2023	1,9
Gouvernement du Japon 0 % 11-09-2023	1,9
Gouvernement du Japon 0 % 25-09-2023	1,8
Gouvernement du Japon 0 % 14-08-2023	1,3
Gouvernement du Japon 0 % 04-09-2023	1,1
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,50 % 15-01-2028	1,0
Gouvernement du Japon 0 % 07-08-2023	0,9
Realkredit Danmark AS 1,00 % 01-01-2024	0,9
Obligations du Trésor des États-Unis 1,38 % 15-11-2040	0,9
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	0,8
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,25 % 15-01-2025	0,7
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-04-2025	0,6
RIPON Mortgages PLC 1X, taux variable 28-08-2056	0,6
Gouvernement d'Israël 0 % 30-11-2023	0,6
Realkredit Danmark AS 1,00 % 01-04-2024	0,6
Gouvernement du Japon 0,10 % 10-03-2028	0,6
Obligations du Trésor des États-Unis 1,88 % 15-02-2041	0,6
Nykredit Realkredit AS 1,50 % 01-10-2053, rachetables	0,5
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	58,7

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS VENDEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur	
Contrat à terme standardisé à très long terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans (CME)	–
Contrats à terme standardisés sur obligations Euro-Schatz	–
Contrat à terme standardisé sur des obligations Euro-BTP (EUX)	–
Contrat à terme standardisé sur des obligations Euro-BUXL à 30 ans (EUX)	–
Contrat à terme standardisé sur des obligations Euro-OAT (EUX)	–
Contrat à terme standardisé (vendeur) sur obligations Euro-BTP (EUX)	–
Contrat à terme standardisé sur des obligations gouvernementales à long terme (ICE)	–
Contrat à terme standardisé sur des obligations canadiennes à 10 ans (MSE)	–
Contrat à terme standardisé sur des obligations du Trésor ASX à 10 ans (SFE)	–
Contrat à terme standardisé sur des obligations du Trésor ASX à 3 ans (SFE)	–
Contrat à terme standardisé sur des obligations du gouvernement du Japon à 10 ans (SGX Mini)	–
Option d'achat sur obligations du Trésor américain à dix ans (CBOT) – option d'achat souscrite @ 115,50 \$ éch. 22-07-2023	–
Option d'achat sur obligations du Trésor américain à dix ans (CBOT) – option de vente souscrite @ 111,50 \$ éch. 22-07-2023	–
Option d'achat sur obligations du Trésor américain (CBOT) – option d'achat souscrite @ 131,0 \$ éch. 22-07-2023	–
Option d'achat sur obligations du Trésor américain (CBOT) – option de vente souscrite @ 123,0 \$ éch. 22-07-2023	–
Contrat à terme standardisé SOFR de CME à 3 mois	0,1
Contrat à terme standardisé sur des obligations Euro-BOBL (EUX)	0,1
Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	0,2
Valeur liquidative totale du Fonds	1,1 milliard \$

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