

FONDS D'OBLIGATIONS MONDIALES IG PIMCO

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2022

Aperçu du portefeuille du Fonds sous-jacent*

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS

ACHETEUR DU FONDS SOUS-JACENT	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Trésorerie et équivalents de trésorerie	51,4
Contrat à terme sur des obligations du Trésor américain à 5 ans (CBOT)	11,7
Contrat à terme sur des obligations du Trésor américain à 10 ans (CBOT)	7,5
Fannie Mae/Freddie Mac 3,50 % 01-08-2052	2,7
Contrat à terme sur des obligations du gouvernement du Japon à 10 ans (SGX Mini)	1,6
Contrat à terme sur des obligations du Trésor ASX à 10 ans (SFE)	1,5
Contrat à très long terme sur obligations du Trésor américain de CME	1,3
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,50 % 15-01-2028	1,2
Obligations du Trésor des États-Unis 1,38 % 15-11-2040	1,1
RIPON Mortgages PLC 1X, taux variable 28-08-2056	0,9
Fannie Mae/Freddie Mac 3,00 % 01-08-2051	0,8
Nykredit Realkredit AS 1,00 % 01-10-2050, rachetables	0,7
Obligations du Trésor des États-Unis 1,88 % 15-02-2041	0,7
Gouvernement de Singapour 1,63 % 01-07-2031	0,7
Fannie Mae/Freddie Mac 4,00 % 01-08-2052	0,7
Nykredit Realkredit AS 1,50 % 01-10-2053, rachetables	0,6
Gouvernement du Japon 1,20 % 20-09-2035	0,6
Gouvernement de la Hongrie 5,25 % 16-06-2029	0,6
Genesis Mortgage Funding 2022-1 PLC, taux variable 15-09-2059	0,5
Obligations du Trésor des États-Unis 2,88 % 15-05-2052	0,5
Gouvernement de Singapour 2,88 % 01-09-2030	0,4
The Goldman Sachs Group Inc., taux variable 24-02-2028, rachetables	0,4
Obligations du Trésor des États-Unis 4,25 % 15-05-2039	0,4
Gouvernement de l'Espagne 3,45 % 30-07-2066	0,4
Gouvernement de l'Australie 4,25 % 21-04-2026	0,4
	89,3

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS

VENDEUR DU FONDS SOUS-JACENT** % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

Contrat à terme sur des obligations Euro-BOBL (EUX)	(6,9)
Contrat à terme Ultra sur des obligations du Trésor américain à 10 ans (CME)	(5,3)
Contrats à terme sur des obligations Euro-Schatz (EUX)	(2,1)
Contrat à terme sur des obligations Euro-BUND (EUX)	(2,1)
Contrat à terme sur des obligations Euro-OAT (EUX)	(1,6)
Contrat à terme sur des obligations gouvernementales à long terme (ICE)	(1,0)
Contrat à terme sur des obligations canadiennes à 10 ans (MSE)	(0,4)
Contrat à terme sur des obligations Euro-BTP (EUX)	(0,3)
Contrat à terme sur des obligations Euro-BUXL à 30 ans (EUX)	(0,1)
Contrat à terme sur obligations du Trésor américain à long terme (CBOT)	(0,1)
Contrat à terme sur des obligations du Trésor ASX à 3 ans (SFE)	–
	(19,9)

VALEUR LIQUIDATIVE TOTALE (EN MILLIERS DE DOLLARS) 28 465

* 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.sedar.com.

** Les positions vendeur se composent de contrats à terme standardisés sur les titres énumérés.

FONDS D'OBLIGATIONS MONDIALES IG PIMCO

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 30 juin 2022

RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Positions acheteur	
Obligations	79,0
Trésorerie et équivalents de trésorerie	51,4
	130,4
Positions vendeur	
Obligations	(19,9)
Autres éléments d'actif (de passif) net	(10,5)
Total	100,0

RÉPARTITION SECTORIELLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Titres adossés à des créances hypothécaires	24,4
Obl. de sociétés	18,8
Gouvernements étrangers	16,0
Gouvernements provinciaux	0,2
Gouvernement fédéral	(0,3)
	59,1

NOTES DE CRÉDIT	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
AAA	17,5
AA	10,0
A	6,3
BBB	9,8
Inférieure à BBB	5,9
Sans note	5,9
	55,4

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 30 juin 2022 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.