

FONDS DURABLE D'OBLIGATIONS MONDIALES CANADA VIE

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2022

Aperçu du portefeuille

RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	101,4
Obligations	100,6
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)*	0,8
Trésorerie et placements à court terme	2,5
Autres éléments d'actif (de passif)	(3,9)

RÉPARTITION RÉGIONALE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
États-Unis	55,5
Belgique	8,5
Canada	5,6
Allemagne	5,2
Royaume-Uni	4,8
France	4,3
Japon	3,5
Autre	3,1
Australie	3,0
Trésorerie et placements à court terme	2,5
Suisse	2,3
Espagne	1,9
Mexique	1,9
Luxembourg	1,1
Pays-Bas	0,7
Autres éléments d'actif (de passif)	(3,9)

RÉPARTITION SECTORIELLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations d'État étrangères	46,1
Obligations de sociétés	22,4
Titres adossés à des créances hypothécaires	19,2
Obligations supranationales	9,7
Obligations fédérales	2,8
Trésorerie et placements à court terme	2,5
Autre	0,8
Obligations provinciales	0,4
Autres éléments d'actif (de passif)	(3,9)

* Les valeurs théoriques représentent -40,4 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur).

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS ACHETEUR

Émetteur	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations du Trésor des États-Unis 4,13 % 15-11-2032	9,1
Union européenne 2,00 % 04-10-2027	4,9
Obligations du Trésor des États-Unis 3,88 % 30-11-2027	3,8
Union européenne 1,00 % 06-07-2032	3,5
Obligations du Trésor des États-Unis 1,38 % 15-11-2031	3,4
Obligations du Trésor des États-Unis 3,88 % 30-11-2029	3,3
Obligations du Trésor des États-Unis 2,75 % 15-08-2032	3,2
Trésorerie et placements à court terme	2,5
Obligations du Trésor des États-Unis 3,13 % 31-08-2027	2,4
Ginnie Mae 5,00 % 20-08-2052	2,3
Fannie Mae 3,50 % 01-04-2052	2,3
Kreditanstalt für Wiederaufbau 0,13 % 09-01-2032	2,1
Obligations du Trésor des États-Unis 2,38 % 15-02-2042	2,1
Ginnie Mae 3,00 % 20-05-2051	2,0
Gouvernement du Japon 1,40 % 20-09-2052	1,9
Gouvernement du Mexique 7,75 % 29-05-2031	1,9
Fannie Mae 4,00 % 01-01-2050	1,9
Gouvernement du Canada 1,50 % 01-06-2031	1,8
Gouvernement de l'Espagne 2,55 % 31-10-2032	1,6
Gouvernement de l'Allemagne 0 % 15-08-2052	1,6
Gouvernement du Japon 0,90 % 20-06-2042	1,6
Banque de Montréal 0,13 % 26-01-2027	1,3
Fannie Mae 4,50 % 01-08-2052	1,3
Westpac Banking Corp. 1,08 % 05-04-2027	1,3
La Banque Toronto-Dominion 0,86 % 24-03-2027	1,3

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **64,4**

FONDS DURABLE D'OBLIGATIONS MONDIALES CANADA VIE

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 31 décembre 2022

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS VENDEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur	
Contrats à terme standardisés sur obligations du Trésor américain à 2 ans	–
Contrats à très long terme sur obligations du Trésor américain de CME	–
Contrats à terme standardisés sur obligations euro-OAT	–
Contrats à terme standardisés sur obligations Euro-Schatz	0,1
Contrats à terme standardisés sur euro-obligations à long terme du gouvernement italien (BTP)	0,1
Contrats à terme standardisés sur obligations Euro-Bobl	0,2
Contrats à terme standardisés sur euro-obligations	0,4
Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	0,8

Valeur liquidative totale du Fonds 110,0 millions \$

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 31 décembre 2022 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.