

FNB DE REVENU FIXE CANADIEN DE BASE PLUS MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2024

Aperçu du portefeuille

RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	98,1
Obligations	92,9
Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)*	5,2
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)*	–
Fonds/billets négociés en bourse	2,9
Autres éléments d'actif (de passif)	1,9
Actions	0,1
Trésorerie et équivalents de trésorerie	(3,0)
Options sur swaps achetées**	–
Options sur swaps vendues**	–

RÉPARTITION RÉGIONALE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Canada	84,6
États-Unis	11,8
Autres éléments d'actif (de passif)	1,9
Autre	1,2
Mexique	1,1
Royaume-Uni	0,9
Singapour	0,4
Irlande	0,3
Bésil	0,2
France	0,1
Australie	0,1
Japon	0,1
Luxembourg	0,1
Chili	0,1
Bahamas	0,1
Trésorerie et équivalents de trésorerie	(3,0)

RÉPARTITION SECTORIELLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations de sociétés	53,8
Obligations provinciales	22,2
Obligations fédérales	13,0
Obligations d'État étrangères	8,4
Fonds/billets négociés en bourse	2,9
Autres éléments d'actif (de passif)	1,9
Titres adossés à des créances hypothécaires	0,7
Autre	0,1
Trésorerie et équivalents de trésorerie	(3,0)

OBLIGATIONS PAR NOTE DE CRÉDIT†	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
AAA	9,7
AA	18,2
A	24,8
BBB	26,6
Inférieure à BBB	5,0
Sans note	8,6

* Les valeurs théoriques représentent 5,2 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur) et –2,5 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur).

** Les valeurs théoriques représentent 27,8 % de la valeur liquidative des options sur swaps achetées et –13,8 % de la valeur liquidative des options sur swaps vendues.

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



MACKENZIE
Placements

FNB DE REVENU FIXE CANADIEN DE BASE PLUS MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 30 juin 2024

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS ACHETEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur/Fonds sous-jacent	
Province de l'Ontario 4,15 % 02-06-2034	6,2
Province de Québec 4,40 % 01-12-2055	3,3
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,12 % 15-04-2025	2,8
Gouvernement du Canada 2,75 % 01-12-2055	2,5
Trésorerie et équivalents de trésorerie	2,2
Obligations du Trésor des États-Unis 4,63 % 15-05-2054	1,8
FINB Obligations canadiennes totales Mackenzie	1,8
Province de Québec 4,45 % 01-09-2034	1,8
Province de l'Alberta 3,10 % 01-06-2050	1,8
Province de l'Ontario 4,15 % 02-12-2054	1,7
Gouvernement du Canada 3,00 % 01-06-2034	1,6
Obligations du Trésor des États-Unis 4,25 % 15-02-2054	1,4
TransCanada Trust, taux variable 18-05-2077, rachetables 2027	1,4
Rogers Communications Inc., taux variable 17-12-2081	1,1
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	1,1
Gouvernement du Mexique 7,75 % 23-11-2034	1,0
Province de l'Alberta 2,95 % 01-06-2052	0,9
Gouvernement du Canada 0,50 % 01-12-2050	0,9
Province de la Saskatchewan 2,80 % 02-12-2052	0,8
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 1,50 % 15-02-2053	0,8
Province de l'Ontario 4,05 % 02-02-2032	0,8
Brookfield Renewable Energy Partners ULC 3,63 % 15-01-2027, rachetables 2026	0,7
Fonds hypothécaire Canada 3,84 % 01-11-2028	0,7
British Columbia Investment Management 4,90 % 02-06-2033	0,6
Vidéotron Itée 3,63 % 15-06-2028	0,6
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	40,3

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS VENDEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur	
Indice Markit North American Investment Grade CDX option de vente @ 95,00 \$ éch. 17-07-2024	—
Indice Markit North American Investment Grade CDX option de vente @ 95,00 \$ éch. 17-07-2024 A	—
Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans	—
Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	—
Valeur liquidative totale du FNB	685,3 millions \$

Pour le prospectus et d'autres renseignements concernant le ou les fonds sous-jacents du portefeuille, veuillez consulter les adresses suivantes : www.placementsmackenzie.com ou www.sedarplus.ca.

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 30 juin 2024 en raison des opérations de portefeuille continues du FNB. 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 FNB, où elles sont disponibles dans les 90 jours.



MACKENZIE
Placements