

FNB D'OBLIGATIONS SANS CONTRAINTES MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2024

Aperçu du portefeuille

RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	82,3
Obligations	82,2
Options achetées*	0,1
Options vendues*	–
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)**	–
Autres éléments d'actif (de passif)	7,7
Fonds/billets négociés en bourse	4,2
Trésorerie et équivalents de trésorerie	2,8
Placements à court terme	1,9
Actions	1,1
Swaps†	–
Options sur swaps achetées††	–
Options sur swaps vendues††	–

RÉPARTITION RÉGIONALE

RÉPARTITION RÉGIONALE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
États-Unis	38,0
Canada	35,9
Autres éléments d'actif (de passif)	7,7
Mexique	3,9
Trésorerie et équivalents de trésorerie	2,8
Allemagne	2,7
Autre	1,3
Afrique du Sud	1,3
Nouvelle-Zélande	1,3
Luxembourg	1,2
Irlande	1,1
Brésil	0,9
Pays-Bas	0,8
Royaume-Uni	0,4
France	0,3
Bahamas	0,2
Colombie	0,2

RÉPARTITION SECTORIELLE

RÉPARTITION SECTORIELLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations de sociétés	62,6
Obligations d'État étrangères	15,3
Autres éléments d'actif (de passif)	7,7
Fonds/billets négociés en bourse	4,2
Trésorerie et équivalents de trésorerie	2,8
Prêts à terme	2,5
Dépôts à court terme	1,9
Obligations fédérales	1,3
Services publics	0,6
Obligations provinciales	0,3
Énergie	0,2
Titres adossés à des créances hypothécaires	0,2
Services financiers	0,1
Services de communication	0,1
Consommation discrétionnaire	0,1
Autre	0,1

OBLIGATIONS PAR NOTE DE CRÉDIT§

OBLIGATIONS PAR NOTE DE CRÉDIT§	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
AAA	5,6
AA	10,5
A	4,8
BBB	24,7
Inférieure à BBB	27,8
Sans note	8,8

* Les valeurs théoriques représentent 4,0 % de la valeur liquidative des options achetées et –3,7 % de la valeur liquidative des options vendues.

** Les valeurs théoriques représentent –3,0 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur).

† Les valeurs théoriques représentent 4,5 % de la valeur liquidative des swaps.

†† Les valeurs théoriques représentent 26,1 % de la valeur liquidative des options sur swaps achetées et –24,8 % 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 D'OBLIGATIONS SANS CONTRAINTES MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 30 juin 2024

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS ACHETEUR

% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

Émetteur/Fonds sous-jacent	
Trésorerie et équivalents de trésorerie	2,8
FINB Obligations toutes sociétés canadiennes Mackenzie	2,1
Obligations du Trésor des États-Unis 3,50 % 15-02-2033	1,9
Obligation fédérale 2,10 % 12-04-2029	1,9
Obligations du Trésor des États-Unis 0,0 % 05-09-2024	1,9
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-02-2052	1,3
Gouvernement du Mexique 7,75 % 23-11-2034	1,3
Gouvernement de l'Afrique du Sud 8,88 % 28-02-2035	1,3
Gouvernement de la Nouvelle-Zélande 4,25 % 15-05-2034	1,3
Gouvernement du Mexique 8,50 % 01-03-2029	1,1
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	1,0
Société Financière Internationale 7,75 % 18-01-2030	0,9
Société Financière Manuvie, taux variable 19-06-2082	0,9
Continental Resources Inc. 4,90 % 01-06-2044, rachetables 2043	0,8
Banque de Montréal, taux variable 26-11-2080	0,8
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-01-2032	0,8
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 1,50 % 15-02-2053	0,8
Gouvernement de l'Allemagne 0 % 15-08-2052	0,7
FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	0,7
Financière Sun Life inc., taux variable 30-06-2081	0,7
Enbridge Inc., taux variable 12-04-2078, rachetables 2028	0,7
América Móvil SAB de CV 9,50 % 27-01-2031	0,7
Banque Royale du Canada, taux variable 24-11-2081	0,7
FINB Obligations de marchés émergents Mackenzie (couvert en \$ CA)	0,7
FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	0,7

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale

28,5

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS VENDEUR

% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

Émetteur	
Indice Markit North American Investment Grade CDX option de vente souscrite @ 80,00 \$ éch. 18-09-2024 B	—
Indice Markit North American Investment Grade CDX option de vente souscrite @ 72,50 \$ éch. 17-07-2024	—
Indice Markit North American Investment Grade CDX option de vente souscrite @ 85,00 \$ éch. 21-08-2024	—
Indice Markit North American Investment Grade CDX option de vente souscrite @ 80,00 \$ éch. 18-09-2024	—
Indice Markit North American Investment Grade CDX option de vente souscrite @ 98,00 \$ éch. 17-07-2024	—
iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF, option de vente souscrite @ 69,00 \$ éch. 19-07-2024	—
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

942,9 millions \$

Le FNB ne détenait aucune position vendeur à la clôture de la période.

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