

FONDS À RENDEMENT ABSOLU DE TITRES DE CRÉANCE MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2024

Aperçu du portefeuille

RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Obligations	79,0	(1,3)	77,7
<i>Obligations</i>	66,3	(1,3)	65,0
<i>Contrats à terme standardisés*</i>	12,7	–	12,7
Trésorerie et équivalents de trésorerie	18,0	–	18,0
Fonds privés	2,8	–	2,8
Autres éléments d'actif (de passif)	1,3	–	1,3
Actions	0,6	–	0,6
Swaps**	–	–	–
Options sur swaps achetées†	–	–	–
Options sur swaps vendues†	–	–	–
Fonds/billets négociés en bourse	0,5	(0,9)	(0,4)

RÉPARTITION RÉGIONALE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
États-Unis	36,3	(1,9)	34,4
Canada	33,4	(0,3)	33,1
Trésorerie et équivalents de trésorerie	18,0	–	18,0
Australie	5,3	–	5,3
Allemagne	1,5	–	1,5
Autres éléments d'actif (de passif)	1,3	–	1,3
Mexique	1,2	–	1,2
France	0,9	–	0,9
Suisse	0,7	–	0,7
Royaume-Uni	0,7	–	0,7
Chine	0,6	–	0,6
Luxembourg	0,6	–	0,6
Pays-Bas	0,5	–	0,5
Inde	0,4	–	0,4
Italie	0,3	–	0,3
Hong Kong	0,2	–	0,2
Colombie	0,2	–	0,2
Irlande	0,1	–	0,1
Swaps	–	–	–

RÉPARTITION SECTORIELLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Obligations de sociétés	63,4	(1,3)	62,1
Trésorerie et équivalents de trésorerie	18,0	–	18,0
Obligations d'État étrangères	14,9	–	14,9
Fonds privés	2,8	–	2,8
Autres éléments d'actif (de passif)	1,3	–	1,3
Services financiers	0,6	–	0,6
Titres adossés à des créances hypothécaires	0,4	–	0,4
Obligations supranationales	0,3	–	0,3
Fonds/billets négociés en bourse	0,5	(0,9)	(0,4)

OBLIGATIONS PAR NOTE DE CRÉDIT††	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
AAA	0,3
AA	0,1
A	3,2
BBB	8,8
BB	23,8
B	12,6
Inférieure à BBB	5,7
Sans note	10,5

* Les valeurs théoriques représentent 12,7 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur) et –3,8 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur).

** Les valeurs théoriques représentent 19,9 % de la valeur liquidative des swaps.

† Les valeurs théoriques représentent 12,3 % de la valeur liquidative des options sur swaps achetées et –11,8 % 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

FONDS À RENDEMENT ABSOLU DE TITRES DE CRÉANCE 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 placements à court terme	30,7
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	2,1
Northleaf Private Credit II LP ¹⁾	1,9
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 31-01-2025	1,7
Inter Pipeline Ltd., taux variable 19-11-2079, rachetables 2029	1,4
Obligation fédérale 2,10 % 12-04-2029	1,3
Algonquin Power & Utilities Corp., taux variable 18-01-2082	1,1
Pembina Pipeline Corp., taux variable 25-01-2081	1,1
CHIP Mortgage Trust 1,50 % 15-11-2024	1,0
Compagnie Crédit Ford du Canada 2,96 % 16-09-2026	1,0
Vidéotron Itée 4,50 % 15-01-2030, rachetables 2024	0,9
Keyera Corp., taux variable 13-06-2079, rachetables 2029	0,9
Vidéotron Itée 3,13 % 15-01-2031	0,9
Sagard Credit Partners II LP ¹⁾	0,9
Corporation Parkland du Canada 4,50 % 01-10-2029	0,9
Gouvernement du Mexique 7,75 % 23-11-2034	0,9
Weatherford International Ltd. 8,63 % 30-04-2030	0,9
Vermilion Energy Inc. 6,88 % 01-05-2030	0,8
Produits Kruger S.E.C. 5,38 % 09-04-2029	0,8
Domtar Corp. 6,75 % 01-10-2028	0,8
Coinbase Global Inc. 3,63 % 01-10-2031	0,8
Gray Television Inc. 5,38 % 15-11-2031	0,8
Tamarack Valley Energy Ltd. 7,25 % 10-05-2027	0,8
Mattamy Group Corp. 4,63 % 01-03-2030, rachetables 2025	0,8
MEG Energy Corp. 5,88 % 01-02-2029	0,8
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	56,0

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS VENDEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur/Fonds sous-jacent	
SPDR Bloomberg Barclays Convertible Securities ETF	(0,8)
TRI Pointe Group Inc. 5,70 % 15-06-2028	(0,3)
Credit Acceptance Corp. 6,63 % 15-03-2026	(0,3)
Bombardier Inc. 7,88 % 15-04-2027	(0,3)
W. R. Grace Holdings LLC 5,63 % 15-08-2029	(0,2)
Eco Material Technologies Inc. 7,88 % 31-01-2027	(0,2)
iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF	(0,1)
Indice Markit North American Investment Grade CDX option de vente souscrite @ 98,00 \$ éch. 17-07-2024	—
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	(2,2)
Valeur liquidative totale du Fonds	96,3 millions \$

1) L'émetteur de ce titre est lié au gestionnaire.

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 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.



MACKENZIE
Placements