

FNB D'OBLIGATIONS SANS CONTRAINTES MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2023

Aperçu du portefeuille

RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	91,9
Obligations	91,8
Options achetées*	0,1
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)**	–
Autres éléments d'actif (de passif)	2,8
Placements à court terme	2,3
Trésorerie et équivalents de trésorerie	1,9
Actions	1,1
Options sur swaps achetées†	–
Options sur swaps vendues†	–
Swaps‡	–

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
États-Unis	42,9
Canada	37,9
Autres éléments d'actif (de passif)	2,8
Autre	2,3
Brésil	2,2
Trésorerie et équivalents de trésorerie	1,9
Mexique	1,8
Luxembourg	1,4
Afrique du Sud	1,3
Irlande	1,1
Royaume-Uni	1,0
Allemagne	0,9
Pays-Bas	0,9
Nouvelle-Zélande	0,6
Australie	0,4
Colombie	0,3
Bahamas	0,3

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations de sociétés	69,8
Obligations d'État étrangères	14,9
Obligations fédérales	3,0
Prêts à terme	2,9
Autres éléments d'actif (de passif)	2,8
Trésorerie et équivalents de trésorerie	1,9
Billets à escompte de gouvernements étrangers à court terme	1,9
Obligations provinciales	1,0
Services publics	0,6
Billets à escompte fédéraux à court terme	0,4
Énergie	0,2
Titres adossés à des créances hypothécaires	0,2
Services de communication	0,1
Services financiers	0,1
Autre	0,1
Consommation discrétionnaire	0,1

OBLIGATIONS PAR NOTE DE CRÉDIT††	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
AAA	6,4
AA	13,4
A	5,2
BBB	22,4
Inférieure à BBB	31,0
Sans note	7,2

* Les valeurs théoriques représentent 7,5 % de la valeur liquidative des options achetées.

** Les valeurs théoriques représentent –11,3 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur).

† Les valeurs théoriques représentent 20,0 % de la valeur liquidative des options sur swaps achetées et –7,9 % 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. Ce tableau présente uniquement les obligations détenues directement par le FNB.

§ Les valeurs théoriques représentent 4,8 % de la valeur liquidative des swaps. La répartition effective présente l'exposition du FNB par portefeuille, région ou secteur calculée en combinant les placements directs et indirects du FNB.



MACKENZIE
Placements

FNB D'OBLIGATIONS SANS CONTRAINTES MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 31 décembre 2023

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS ACHETEUR

% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

Émetteur/Fonds sous-jacent	
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-07-2024	2,5
FINB Obligations toutes sociétés canadiennes Mackenzie	2,3
Obligations du Trésor des États-Unis 3,50 % 15-02-2033	2,0
Trésorerie et équivalents de trésorerie	1,9
Obligations du Trésor des États-Unis 0,0 % 25-09-2024	1,9
FINB Obligations à court terme canadiennes Mackenzie	1,7
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-02-2052	1,4
Gouvernement de l'Afrique du Sud 8,88 % 28-02-2035	1,3
Gouvernement du Brésil 10,00 % 01-01-2027	1,1
Société Financière Internationale 7,75 % 18-01-2030	1,0
Microsoft Corp. 2,53 % 01-06-2050	1,0
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	1,0
Société Financière Manuvie, taux variable 19-06-2082	0,9
Gouvernement de l'Allemagne 0 % 15-08-2052	0,9
Continental Resources Inc. 4,90 % 01-06-2044, rachetables 2043	0,8
Banque de Montréal, taux variable 26-11-2080	0,8
América Móvil SAB de CV 9,50 % 27-01-2031	0,8
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 1,50 % 15-02-2053	0,8
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-01-2032	0,8
FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	0,8
Enbridge Inc., taux variable 12-04-2078, rachetables 2028	0,8
FINB Obligations de marchés émergents Mackenzie (couvert en \$ CA)	0,7
Financière Sun Life inc., taux variable 30-06-2081	0,7
FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	0,7
Banque Canadienne Impériale de Commerce, taux variable 28-07-2082	0,7
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	29,3

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS VENDEUR

% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

Émetteur	
Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans	—
Indice Markit North American Investment Grade CDX option de vente souscrite @ 97,00 \$ éch. 21-02-2024	—
Indice Markit North American Investment Grade CDX option de vente souscrite @ 93,00 \$ éch. 17-01-2024	—
Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	—
Valeur liquidative totale du FNB	888,0 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 31 décembre 2023 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