

FNB DE REVENU FIXE CANADIEN DE BASE PLUS MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2023

Aperçu du portefeuille

RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	94,6
Obligations	85,9
Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)*	8,8
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)*	(0,1)
Autres éléments d'actif (de passif)	4,2
Fonds/billets négociés en bourse	4,0
Options sur swaps achetées**	–
Options sur swaps vendues**	–
Trésorerie et équivalents de trésorerie	(2,8)

RÉPARTITION RÉGIONALE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Canada	80,2
États-Unis	15,2
Autres éléments d'actif (de passif)	4,2
Royaume-Uni	1,1
Singapour	0,5
Brésil	0,4
Mexique	0,2
Australie	0,2
Panama	0,2
Luxembourg	0,2
Irlande	0,1
Chili	0,1
Chine	0,1
Bahamas	0,1
Trésorerie et équivalents de trésorerie	(2,8)

RÉPARTITION SECTORIELLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations de sociétés	49,8
Obligations provinciales	23,4
Obligations fédérales	10,4
Obligations d'État étrangères	9,9
Autres éléments d'actif (de passif)	4,2
Fonds/billets négociés en bourse	4,0
Titres adossés à des créances hypothécaires	0,9
Prêts à terme	0,2
Trésorerie et équivalents de trésorerie	(2,8)

OBLIGATIONS PAR NOTE DE CRÉDIT†	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
AAA	7,5
AA	19,1
A	23,8
BBB	21,4
Inférieure à BBB	5,7
Sans note	8,4

* Les valeurs théoriques représentent 8,5 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur) et –9,7 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur).

** Les valeurs théoriques représentent 8,2 % de la valeur liquidative des options sur swaps achetées et –1,4 % 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 31 décembre 2023

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS ACHETEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur/Fonds sous-jacent	
Province de l'Ontario 3,65 % 02-06-2033	7,3
Gouvernement du Canada 0 % 29-02-2024	5,5
Province de Québec 4,40 % 01-12-2055	4,5
Gouvernement du Canada 2,75 % 01-06-2033	4,1
Province de Québec 3,60 % 01-09-2033	3,3
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,50 % 15-04-2024	2,7
FINB Obligations canadiennes totales Mackenzie	2,5
Province de l'Alberta 3,10 % 01-06-2050	1,5
Rogers Communications Inc., taux variable 17-12-2081	1,2
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 1,50 % 15-02-2053	1,0
Province de l'Alberta 2,95 % 01-06-2052	1,0
Province de la Colombie-Britannique 3,55 % 18-06-2033	1,0
Fonds hypothécaire Canada 3,84 % 01-11-2028	0,9
TransCanada Trust, taux variable 18-05-2077, rachetables 2027	0,9
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-02-2052	0,9
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	0,8
Province de la Saskatchewan 2,80 % 02-12-2052	0,8
FINB Obligations à long terme du gouvernement canadien Mackenzie	0,8
Gouvernement du Canada 0,50 % 01-12-2050	0,8
FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	0,7
Province de l'Ontario 4,05 % 02-02-2032	0,7
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-02-2051	0,7
Province du Manitoba 3,20 % 05-03-2050	0,6
Banque de Montréal 4,71 % 07-12-2027	0,6
Brookfield Renewable Energy Partners ULC 3,63 % 15-01-2027, rachetables 2026	0,6
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	45,4

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS VENDEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur	
Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans	(0,1)
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	(0,1)
Valeur liquidative totale du FNB	509,2 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