

FNB DE REVENU FIXE À RENDEMENT ÉLEVÉ MONDIAL MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2023

Aperçu du portefeuille

RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	91,3
Obligations	91,4
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)*	(0,1)
Autres éléments d'actif (de passif)	5,3
Actions	1,9
Trésorerie et équivalents de trésorerie	1,1
Fonds/billets négociés en bourse	0,4
Options sur swaps achetées**	—

RÉPARTITION RÉGIONALE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
États-Unis	40,2
Canada	27,1
Luxembourg	5,3
Autres éléments d'actif (de passif)	5,3
Pays-Bas	4,2
Autre	3,2
Royaume-Uni	2,7
Mexique	2,6
Brésil	2,5
Irlande	1,3
Colombie	1,1
Trésorerie et équivalents de trésorerie	1,1
Chili	1,0
France	0,8
Italie	0,6
Japon	0,5
Malte	0,5

RÉPARTITION SECTORIELLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations de sociétés – Produits industriels	42,9
Obligations de sociétés – Énergie	13,8
Obligations de sociétés – Services financiers	9,8
Obligations de sociétés – Communications	6,9
Obligations d'État étrangères	5,9
Obligations de sociétés – Infrastructure	5,7
Autres éléments d'actif (de passif)	5,3
Prêts à terme	3,0
Obligations de sociétés – Biens immobiliers	1,7
Obligations fédérales	1,5
Trésorerie et équivalents de trésorerie	1,1
Services publics	0,8
Énergie	0,6
Fonds/billets négociés en bourse	0,4
Services financiers	0,3
Titres adossés à des créances hypothécaires	0,2
Autre	0,1

* Les valeurs théoriques représentent –10,6 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur).

** Les valeurs théoriques représentent 391,0 % de la valeur liquidative des options sur swaps achetées.

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS ACHETEUR

Émetteur	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,50 % 15-04-2024	1,5
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	1,1
Gouvernement du Brésil 10,00 % 01-01-2027	1,1
FAGE International SA 5,63 % 15-08-2026, rachetables 2022	1,1
Trésorerie et équivalents de trésorerie	1,1
Enel SPA 2,25 % 12-07-2031	1,0
Keyera Corp., taux variable 13-06-2079, rachetables 2029	0,9
Minerva Merger Sub Inc. 6,50 % 15-02-2030	0,9
Rogers Communications Inc., taux variable 15-03-2082	0,8
Inter Pipeline Ltd., taux variable 26-03-2079, rachetables 2029	0,8
Vermilion Energy Inc. 6,88 % 01-05-2030	0,8
Uber Technologies Inc. 8,00 % 01-11-2026, rachetables 2022	0,7
Corporation Parkland du Canada 4,50 % 01-10-2029	0,7
CCO Holdings LLC 6,38 % 01-09-2029	0,7
TransCanada Trust, taux variable 18-05-2077, rachetables 2027	0,7
Capital Power Corp., taux variable 09-09-2082	0,7
Lamb Weston Holdings Inc. 4,38 % 31-01-2032	0,7
Vidéotron Itée 3,63 % 15-06-2028	0,7
Gartner Inc. 3,63 % 15-06-2029	0,7
Gouvernement du Mexique 7,50 % 03-06-2027	0,7
Arcos Dorados BV 6,13 % 27-05-2029	0,6
Guala Closures SPA 3,25 % 15-06-2028	0,6
Sealed Air Corp. 6,13 % 01-02-2028	0,6
Murphy Oil USA Inc. 3,75 % 15-02-2031	0,6
Atlantica Sustainable Infrastructure PLC 4,13 % 15-06-2028	0,6

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **20,2**

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS VENDEUR

Émetteur	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans	(0,1)
Contrats à très long terme sur obligations du Trésor américain de CME	—

Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **(0,1)**

Valeur liquidative totale du FNB **250,9 millions \$**

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 30 juin 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.