

FNB D'OBLIGATIONS SANS CONTRAINTES MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2023

Aperçu du portefeuille

RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	85,5
Obligations	85,4
Options achetées*	0,1
Options vendues*	–
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)**	–
Autres éléments d'actif (de passif)	10,8
Placements à court terme	2,1
Actions	1,1
Trésorerie et équivalents de trésorerie	0,5
Options sur swaps achetées†	–
Options sur swaps vendues†	–
Swaps††	–

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
États-Unis	36,8
Canada	34,9
Autres éléments d'actif (de passif)	10,8
Autre	4,0
Mexique	2,6
Brésil	2,0
Allemagne	1,6
Luxembourg	1,5
Royaume-Uni	0,9
Irlande	0,9
Pays-Bas	0,8
Afrique du Sud	0,7
Nouvelle-Zélande	0,6
Chine	0,6
Trésorerie et équivalents de trésorerie	0,5
Japon	0,4
Colombie	0,4

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations de sociétés	63,1
Obligations d'État étrangères	14,7
Autres éléments d'actif (de passif)	10,8
Prêts à terme	3,5
Obligations fédérales	2,8
Billets à escompte fédéraux à court terme	1,8
Obligations provinciales	1,0
Services publics	0,6
Trésorerie et équivalents de trésorerie	0,5
Billets à escompte de gouvernements étrangers à court terme	0,3
Énergie	0,2
Titres adossés à des créances hypothécaires	0,2
Services de communication	0,1
Services financiers	0,1
Consommation discrétionnaire	0,1
Autre	0,1
Obligations municipales	0,1

* Les valeurs théoriques représentent 17,7 % de la valeur liquidative des options achetées et –16,1 % de la valeur liquidative des options vendues.

** Les valeurs théoriques représentent –28,1 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur).

† Les valeurs théoriques représentent 1 126,7 % de la valeur liquidative des options achetées et –704,0 % de la valeur liquidative des options sur swaps vendues.

†† Les valeurs théoriques représentent 4,6 % 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 30 juin 2023

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS ACHETEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur/Fonds sous-jacent	
FINB Obligations toutes sociétés canadiennes Mackenzie	2,1
FINB Obligations de marchés émergents en monnaie locale Mackenzie	1,8
FINB Obligations à court terme canadiennes Mackenzie	1,7
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,50 % 15-04-2024	1,5
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-02-2052	1,5
Gouvernement du Canada, bon du Trésor, 0 % 29-02-2024	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
Gouvernement du Mexique 7,75 % 29-05-2031	0,9
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	0,9
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-02-2051	0,9
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 1,50 % 15-02-2053	0,8
América Móvil SAB de CV 9,50 % 27-01-2031	0,8
Gouvernement de l'Allemagne 0 % 15-08-2052	0,8
Banque de Montréal, taux variable 26-11-2080	0,8
Continental Resources Inc. 4,90 % 01-06-2044, rachetables 2043	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	0,7
République fédérale d'Allemagne, obligations indexées sur l'inflation, 0,10 % 15-04-2046	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
Financière Sun Life inc., taux variable 30-06-2081	0,7
Société Financière Manuvie, taux variable 19-06-2082	0,7
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	25,5

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS VENDEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur	
Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans	—
Contrats à très long terme sur obligations du Trésor américain de CME	—
CDX., option de vente souscrite @ 96,00 \$ éch. 20-09-2023	—
iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF option de vente souscrite @ 66,00 \$ éch. 15-09-2023	—
iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF option de vente souscrite @ 65,00 \$ éch. 15-09-2023	—
iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF option de vente souscrite @ 62,00 \$ éch. 15-09-2023	—
iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF option de vente souscrite @ 67,00 \$ éch. 21-07-2023	—
CDX, option de vente souscrite @ 91,00 \$ éch. 19-07-2023	—
Contrats à terme standardisés à très long terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans	—
Contrats à terme standardisés sur obligations euro-OAT	—
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	909,4 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.com.

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.



MACKENZIE
Placements