

FNB DE REVENU FIXE MONDIAL DE BASE PLUS MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2023

Aperçu du portefeuille

RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	96,9
Obligations	86,1
Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)*	10,9
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)*	(0,1)
Autres éléments d'actif (de passif)	6,0
Actions	0,5
Fonds/billets négociés en bourse	0,4
Options sur swaps achetées**	–
Options sur swaps vendues**	–
Trésorerie et équivalents de trésorerie	(3,8)

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
États-Unis	33,9
Canada	33,3
Autres éléments d'actif (de passif)	6,0
Nouvelle-Zélande	5,0
Mexique	4,9
Brésil	4,2
Allemagne	3,2
Autre	2,8
Australie	2,8
Afrique du Sud	1,7
Royaume-Uni	1,6
Bahamas	1,1
France	0,9
Colombie	0,9
Pays-Bas	0,9
Irlande	0,6
Trésorerie et équivalents de trésorerie	(3,8)

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations d'État étrangères	44,8
Obligations de sociétés	38,5
Obligations fédérales	6,8
Autres éléments d'actif (de passif)	6,0
Obligations provinciales	5,2
Prêts à terme	1,6
Fonds/billets négociés en bourse	0,4
Énergie	0,1
Services de communication	0,1
Titres adossés à des créances hypothécaires	0,1
Services publics	0,1
Services financiers	0,1
Trésorerie et équivalents de trésorerie	(3,8)

OBLIGATIONS PAR NOTE DE CRÉDIT†	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
AAA	13,6
AA	17,3
A	9,2
BBB	17,7
Inférieure à BBB	12,7
Sans note	6,3

* Les valeurs théoriques représentent 10,8 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur) et –8,8 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur).

** Les valeurs théoriques représentent 4,9 % de la valeur liquidative des options sur swaps achetées et –0,8 % 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. Ce tableau présente uniquement les obligations détenues directement par le FNB.



MACKENZIE
Placements

FNB DE REVENU FIXE MONDIAL DE BASE PLUS MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 31 décembre 2023

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS ACHETEUR

Émetteur/Fonds sous-jacent	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations du Trésor des États-Unis 3,50 % 15-02-2033	4,9
Obligations du Trésor des États-Unis 0,0 % 08-08-2024	4,9
Gouvernement du Canada 3,50 % 01-03-2028	4,4
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-02-2052	3,6
Gouvernement de la Nouvelle-Zélande 3,50 % 14-04-2033	2,8
Obligations du Trésor des États-Unis 3,88 % 15-08-2033	2,7
Province de l'Alberta 2,05 % 01-06-2030	2,2
Trésorerie et équivalents de trésorerie	2,1
Gouvernement du Mexique 8,50 % 31-05-2029	2,0
Gouvernement de l'Allemagne 0 % 15-08-2052	1,9
FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)	1,9
Gouvernement de l'Afrique du Sud 8,88 % 28-02-2035	1,6
FINB Obligations américaines totales Mackenzie (couvert en \$ CA)	1,6
Gouvernement du Brésil 10,00 % 01-01-2027	1,6
Gouvernement de l'Australie 1,75 % 21-06-2051	1,5
Province de l'Ontario 4,05 % 02-02-2032	1,5
FINB Obligations de marchés émergents Mackenzie (couvert en \$ CA)	1,5
FINB Obligations à court terme canadiennes Mackenzie	1,4
FINB Obligations toutes sociétés canadiennes Mackenzie	1,4
Gouvernement de la Nouvelle-Zélande 4,25 % 15-05-2034	1,4
FINB TIPS américains Mackenzie (couvert en \$ CA)	1,2
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	1,2
Gouvernement du Brésil 6,25 % 18-03-2031	1,2
Gouvernement du Brésil 10,00 % 01-01-2029	1,1
Bell Canada 5,15 % 14-11-2028	1,1
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	52,7

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)
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	174,2 millions \$

La répartition effective présente l'exposition du FNB par portefeuille, région ou secteur calculée en combinant les placements directs et indirects du FNB.

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