

# FONDS D'OBLIGATIONS STRATÉGIQUE MACKENZIE

## Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2023

### Aperçu du portefeuille

RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	98,6
Obligations	89,9
Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur) *	8,8
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur) *	(0,1)
Autres éléments d'actif (de passif)	1,5
Fonds privés	0,9
Actions	0,2
Options sur swaps achetées **	–
Options sur swaps vendues **	–
Trésorerie et équivalents de trésorerie	(1,2)

### RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Canada	78,8
États-Unis	17,3
Autres éléments d'actif (de passif)	1,5
Royaume-Uni	1,0
Brésil	0,6
Mexique	0,4
Australie	0,4
Autre	0,2
Luxembourg	0,2
Panama	0,2
Bahamas	0,1
Chine	0,1
Irlande	0,1
Chili	0,1
Allemagne	0,1
Colombie	0,1
Trésorerie et équivalents de trésorerie	(1,2)

### RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations de sociétés	50,4
Obligations provinciales	26,0
Obligations fédérales	11,6
Obligations d'État étrangères	9,7
Autres éléments d'actif (de passif)	1,5
Fonds privés	0,9
Titres adossés à des créances hypothécaires	0,4
Prêts à terme	0,3
Services financiers	0,2
Obligations supranationales	0,1
Obligations municipales	0,1
Trésorerie et équivalents de trésorerie	(1,2)

### OBLIGATIONS PAR NOTE DE CRÉDIT† % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

AAA	6,7
AA	20,8
A	23,7
BBB	20,6
Inférieure à BBB	5,0
Sans note	8,3

\* Les valeurs théoriques représentent 8,7 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur) et –9,3 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur).

\*\* Les valeurs théoriques représentent 7,7 % de la valeur liquidative des options sur swaps achetées et –1,3 % 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 Fonds.

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



**MACKENZIE**  
Placements

# FONDS D'OBLIGATIONS STRATÉGIQUE MACKENZIE

## Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 31 décembre 2023

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

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS VENDEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
<b>Émetteur</b>	
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	—
<b>Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale</b>	<b>(0,1)</b>
<b>Valeur liquidative totale du Fonds</b>	<b>395,6 millions \$</b>

Pour le prospectus et d'autres renseignements concernant le ou les fonds sous-jacents du portefeuille, veuillez consulter les adresses suivantes : [www.placementsmackenzie.com](http://www.placementsmackenzie.com) ou [www.sedarplus.ca](http://www.sedarplus.ca).

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 31 décembre 2023 en raison des opérations de portefeuille continues du Fonds. 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 Fonds, où elles sont disponibles dans les 90 jours.



**MACKENZIE**  
Placements