

FNB DE REVENU FIXE À COURT TERME CANADIEN MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2023

Aperçu du portefeuille

RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	96,8
Obligations	96,8
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)*	–
Autres éléments d'actif (de passif)	1,7
Fonds/billets négociés en bourse	1,6
Options sur swaps achetées**	–
Options sur swaps vendues**	–
Trésorerie et équivalents de trésorerie	(0,1)

RÉPARTITION RÉGIONALE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Canada	90,3
États-Unis	7,1
Autres éléments d'actif (de passif)	1,7
Royaume-Uni	0,5
Australie	0,2
Luxembourg	0,1
Japon	0,1
Irlande	0,1
Trésorerie et équivalents de trésorerie	(0,1)

RÉPARTITION SECTORIELLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations de sociétés	62,2
Obligations fédérales	23,4
Obligations provinciales	9,9
Autres éléments d'actif (de passif)	1,7
Fonds/billets négociés en bourse	1,6
Obligations d'État étrangères	0,6
Titres adossés à des créances hypothécaires	0,6
Prêts à terme	0,1
Trésorerie et équivalents de trésorerie	(0,1)

OBLIGATIONS PAR NOTE DE CRÉDIT†	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
AAA	24,4
AA	6,5
A	30,5
BBB	25,1
Inférieure à BBB	1,3
Sans note	9,0

* Les valeurs théoriques représentent –6,2 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur).

** Les valeurs théoriques représentent 1,4 % 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.

LES 25 PRINCIPALES

POSITIONS ACHETEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur/Fonds sous-jacent	
Gouvernement du Canada 3,25 % 01-09-2028	10,7
Gouvernement du Canada 2,75 % 01-09-2027	8,1
Province de l'Ontario 2,40 % 02-06-2026	4,6
Apple Inc. 1,13 % 11-05-2025, rachetables 2025	2,6
Province de l'Ontario 3,60 % 08-03-2028	2,3
Bell Canada Inc. 3,60 % 29-09-2027, rachetables 2027	2,3
Financière Sun Life inc., taux variable 21-11-2033	2,2
Province de Québec 2,75 % 01-09-2028	1,8
Banque Royale du Canada, taux variable 01-02-2033	1,7
Rogers Communications Inc. 3,10 % 15-04-2025	1,6
AltaLink, L.P. 3,40 % 06-06-2024, rachetables 2024	1,5
Banque Nationale du Canada, taux variable 18-08-2026, rachetables 2025	1,4
Fiducie du Canada pour l'habitation 2,25 % 15-12-2025	1,4
Fiducie de placement immobilier Propriétés de Choix 2,85 % 21-05-2027	1,3
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	1,3
Hydro One Inc. 2,54 % 05-04-2024, rachetables 2024	1,3
Fédération des caisses Desjardins du Québec 4,41 % 19-05-2027	1,2
Gouvernement du Canada 4,25 % 01-12-2026, rendement réel	1,2
FINB Obligations à court terme canadiennes Mackenzie	1,1
La Banque Toronto-Dominion 4,48 % 18-01-2028	0,9
OPB Finance Trust 2,98 % 25-01-2027	0,8
La Banque Toronto-Dominion 4,21 % 01-06-2027	0,8
Wells Fargo & Co. 2,98 % 19-05-2026	0,8
TransCanada Trust, taux variable 18-05-2077, rachetables 2027	0,8
Société Financière Manuvie, taux variable 10-03-2033	0,7
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	54,4

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.



MACKENZIE
Placements

FNB DE REVENU FIXE À COURT TERME CANADIEN MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 31 décembre 2023

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS VENDEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur	
Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans de moindre valeur	–
Contrats à terme standardisés sur obligations canadiennes à 5 ans	–
Indice Markit North American Investment Grade CDX option de vente souscrite @ 93,00 \$ éch. 17-01-2024	–
<hr/>	
Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	–
<hr/>	
Valeur liquidative totale du FNB	18,2 millions \$

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.

