

# FNB DE REVENU FIXE À COURT TERME CANADIEN MACKENZIE

## Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2023

### Aperçu du portefeuille

RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	84,1
Obligations	84,1
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)*	–
Placements à court terme	11,7
Autres éléments d'actif (de passif)	2,5
Fonds/billets négociés en bourse	1,6
Trésorerie et équivalents de trésorerie	0,1
Options sur swaps achetées**	–

RÉPARTITION RÉGIONALE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Canada	91,2
États-Unis	5,2
Autres éléments d'actif (de passif)	2,5
Royaume-Uni	0,5
Australie	0,2
Trésorerie et équivalents de trésorerie	0,1
Luxembourg	0,1
Japon	0,1
Singapour	0,1

RÉPARTITION SECTORIELLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations de sociétés	51,6
Obligations provinciales	17,5
Obligations fédérales	14,1
Billets à escompte fédéraux à court terme	11,7
Autres éléments d'actif (de passif)	2,5
Fonds/billets négociés en bourse	1,6
Obligations d'État étrangères	0,5
Prêts à terme	0,3
Titres adossés à des créances hypothécaires	0,1
Trésorerie et équivalents de trésorerie	0,1

\* Les valeurs théoriques représentent –6,3 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur).

\*\* Les valeurs théoriques représentent 190,2 % de la valeur liquidative des options sur swaps achetées.

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.

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS ACHETEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
<b>Émetteur</b>	
Province de l'Ontario 2,40 % 02-06-2026	13,2
Gouvernement du Canada, bon du Trésor, 0 % 29-02-2024	8,0
Gouvernement du Canada 2,75 % 01-09-2027	4,8
Gouvernement du Canada 0 % 07-12-2023	3,7
Province de l'Ontario 3,60 % 08-03-2028	2,9
Fiducie du Canada pour l'habitation 2,25 % 15-12-2025	2,6
Fiducie du Canada pour l'habitation 1,95 % 15-12-2025	1,8
Gouvernement du Canada 4,25 % 01-12-2026, rendement réel	1,7
Banque Royale du Canada, taux variable 30-06-2030, rachetables 2025	1,7
AltaLink, L.P. 3,40 % 06-06-2024, rachetables 2024	1,6
Hydro One Inc. 2,54 % 05-04-2024, rachetables 2024	1,5
Banque Canadienne Impériale de Commerce 2,75 % 07-03-2025	1,3
Gouvernement du Canada 1,00 % 01-09-2026	1,3
Bell Canada Inc. 3,60 % 29-09-2027, rachetables 2027	1,2
Fédération des caisses Desjardins du Québec 5,20 % 01-10-2025	1,2
Wells Fargo & Co. 2,98 % 19-05-2026	1,1
BCI QuadReal Realty 2,55 % 24-06-2026	1,1
Rogers Communications Inc. 3,10 % 15-04-2025	1,1
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	1,1
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 03-07-2029, rachetables 2024	1,1
La Banque Toronto-Dominion 4,48 % 18-01-2028	1,1
North West Redwater Partnership Co. Ltd. 2,80 % 01-06-2027	1,0
Banque de Montréal 1,76 % 10-03-2026	1,0
Société Financière Manuvie, taux variable 20-08-2029, rachetables 2024	1,0
Financière Sun Life inc., taux variable 21-11-2033	0,9
<b>Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale</b>	<b>59,0</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	–
<b>Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale</b>	<b>–</b>

Valeur liquidative totale du FNB 21,6 millions \$



**MACKENZIE**  
Placements