

FNB DE REVENU FIXE CANADIEN DE BASE PLUS MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2023

Aperçu du portefeuille

RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	90,2
Obligations	83,1
Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)*	7,2
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)*	(0,1)
Autres éléments d'actif (de passif)	10,6
Fonds/billets négociés en bourse	4,2
Placements à court terme	2,1
Options sur swaps achetées**	–
Trésorerie et équivalents de trésorerie	(7,1)

RÉPARTITION RÉGIONALE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Canada	83,5
Autres éléments d'actif (de passif)	10,6
États-Unis	9,7
Royaume-Uni	0,9
Singapour	0,5
Brésil	0,5
Australie	0,3
Japon	0,2
Mexique	0,2
Panama	0,2
Chine	0,1
Luxembourg	0,1
Chili	0,1
Irlande	0,1
Bahamas	0,1
Trésorerie et équivalents de trésorerie	(7,1)

RÉPARTITION SECTORIELLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations de sociétés	44,8
Obligations provinciales	21,4
Obligations fédérales	18,7
Autres éléments d'actif (de passif)	10,6
Obligations d'État étrangères	4,4
Fonds/billets négociés en bourse	4,2
Billets à escompte fédéraux à court terme	2,1
Titres adossés à des créances hypothécaires	0,5
Prêts à terme	0,4
Obligations municipales	0,1
Autre	(0,1)
Trésorerie et équivalents de trésorerie	(7,1)

* Les valeurs théoriques représentent 7,2 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur) et –8,0 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur).

** Les valeurs théoriques représentent 567,7 % de la valeur liquidative des options sur swaps achetées.

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS ACHETEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur/Fonds sous-jacent	
Gouvernement du Canada 2,75 % 01-06-2033	4,9
Province de Québec 4,40 % 01-12-2055	4,2
Province de l'Ontario 3,75 % 02-06-2032	3,2
Gouvernement du Canada 2,00 % 01-06-2032	2,3
FINB Obligations canadiennes totales Mackenzie	2,3
Gouvernement du Canada Bons du Trésor du Japon 0 % 29-02-2024	2,1
Province de l'Alberta 3,10 % 01-06-2050	2,0
Province de Québec 3,60 % 01-09-2033	1,7
Province de l'Ontario 3,75 % 02-12-2053	1,5
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,50 % 15-04-2024	1,5
Gouvernement du Canada 1,50 % 01-06-2031	1,4
Province de Québec 3,25 % 01-09-2032	1,3
FINB Obligations de marchés émergents en monnaie locale Mackenzie	1,2
Province de la Colombie-Britannique 1,55 % 18-06-2031	1,0
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 1,50 % 15-02-2053	1,0
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-02-2052	0,9
Province de l'Alberta 2,95 % 01-06-2052	0,9
Province de la Saskatchewan 2,80 % 02-12-2052	0,8
Gouvernement du Canada 0,50 % 01-12-2050	0,7
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-02-2051	0,7
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	0,7
Gouvernement du Canada 1,75 % 01-12-2053	0,7
Rogers Communications Inc., taux variable 17-12-2081	0,7
FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	0,7
Province du Manitoba 3,20 % 05-03-2050	0,6
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	39,0



MACKENZIE
Placements

FNB DE REVENU FIXE CANADIEN DE BASE PLUS MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 30 juin 2023

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS VENDEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur	
Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans	(0,1)
Contrats à terme standardisés sur obligations canadiennes à 30 ans	—
Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	(0,1)
Valeur liquidative totale du FNB	540,7 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.

