

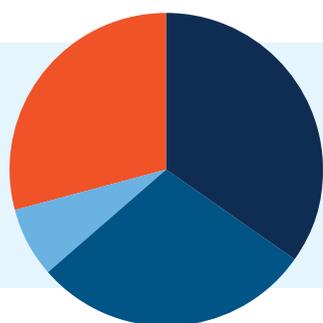
Indice Solactive Select USD Investment Grade Corporate Hedged to CAD TR

Cet indice fait l'objet d'un suivi par QUIG - FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA)

Aperçu de l'indice

- L'indice est pondéré selon la valeur au marché fondé sur des règles, conçu pour mesurer le rendement des obligations de sociétés de première qualité libellées en dollars américains.
- Le risque de change est couvert en dollars canadiens.
- Environ 500 titres, lesquels sont les plus susceptibles de représenter le plus fidèlement l'ensemble de l'indice Solactive USD Investment Grade Corporate Bond, sont inclus dans les indices. Le processus de sélection des titres s'effectue en quatre étapes :
 - Chaque titre sélectionné est classé dans un panier de titres en fonction de sa qualité et de sa durée modifiée. Il existe 10 paniers de qualité et 11 paniers de durée modifiée.
 - La pondération du marché de chaque panier par rapport à l'ensemble des titres sélectionnés est calculée. Selon la pondération de chaque panier, le nombre d'obligations qui représente le panier en question est déterminé.
 - Une fois que le nombre cible d'obligations du panier est déterminé, un nombre correspondant d'obligations est sélectionné, lesquelles présentent le plus grand volume de titres en circulation du panier et ne sont pas inscrites en vertu de la règle 144a relative aux droits d'inscription.
 - Les pondérations sont attribuées aux obligations en fonction de la capitalisation boursière de leur panier.

Caractéristiques de l'indice



Composition par échéance

| | | | |
|----------|------------|----------|-------------|
| ■ 34,9 % | 1 à 5 ans | ■ 7,3 % | 10 à 15 ans |
| ■ 28,8 % | 5 à 10 ans | ■ 29,0 % | 15+ ans |

Qualité du crédit : **BBB**

Durée effective : **7,97 ans**

Rendement à l'échéance : **2,93 %**

Coupon moyen : **4,20 %**

Rendement de la distribution : **3,98 %**

Source : Données du FNB QUIG utilisées comme approximation; Mackenzie, au 31 juillet 2020.

Règles d'inclusion

| | |
|------------------------------|--|
| Admissibilité du pays | <ul style="list-style-type: none"> • Ne comprend que les obligations de sociétés de première qualité libellées en dollars américains. L'emplacement de l'émetteur n'est pas pris en compte. |
| Devises admissibles | <ul style="list-style-type: none"> • Obligations de sociétés de première qualité libellées en dollars américains. |
| Coupon | <ul style="list-style-type: none"> • Coupon nominal à taux fixe. |
| Échéance | <ul style="list-style-type: none"> • Au moins 12 mois avant l'échéance finale. |



Règles d'inclusion

| | | |
|------------------------|--|---|
| Types de titres | Inclus | Exclus |
| | <ul style="list-style-type: none"> Pour que les obligations soient admissibles, un cours doit pouvoir être obtenu auprès d'un fournisseur de cours obligataires reconnu, tel que déterminé par le comité des indices. | <ul style="list-style-type: none"> Titres de créance gouvernementaux Dette quasi souveraine, Dette garantie ou garantie par les gouvernements Titres REGS |

Source : Solactive

Règles de rééquilibrage

| | |
|--|---|
| Changements au sein de l'indice | <p>Les opérations stratégiques sur le capital suivantes entraîneront des changements ou des rajustements à un indice au cours du mois :</p> <p>a) Remboursement anticipé ou intégral : Le produit sera réinvesti dans l'indice à la date d'entrée en vigueur. Pour éviter toute ambiguïté, le dépôt doit être obligatoire; à elle seule, l'offre de dépôt d'une obligation n'entraînera pas d'ajustement de l'indice. Si le dépôt ou l'échange a été fructueux pour au moins 90 % de l'encours, l'obligation sera retirée de l'indice/échangée contre l'obligation correspondante.</p> <p>b) Opérations sur obligation sans intérêt : Une obligation se négocie sans intérêt si son émetteur ne respecte pas son obligation relative au paiement de coupons, ce qui signifie que l'acheteur d'une obligation n'est pas responsable de payer les intérêts accumulés depuis le dernier paiement. Si une obligation est définie comme étant « sans intérêt » au cours du mois, les intérêts courus et les coupons respectifs seront fixés à 0. L'obligation ne sera pas retirée avant le prochain rééquilibrage de fin de mois.</p> <p>c) Obligations en défaut : Si le statut d'une obligation passe à « En défaut », l'obligation demeurera dans l'indice ou le portefeuille à son plus récent prix estimé disponible fourni par la source d'évaluation, jusqu'au prochain rééquilibrage de fin de mois.</p> <p>d) Offres d'échange obligatoire : Si plus de 90 % du montant en circulation est échangé, l'échange sera pris en compte dans le calcul de l'indice en échangeant les obligations pertinentes, de sorte que la pondération de la nouvelle obligation sera la même que celle de l'ancienne obligation échangée.</p> |
| | <ul style="list-style-type: none"> Les flux de trésorerie au cours du mois provenant des paiements d'intérêts et de capital contribuent aux rendements mensuels de l'indice et sont investis directement dans l'indice à la date de prise d'effet. Les titres admissibles émis, mais pas nécessairement réglés au plus tard à la date de rééquilibrage de fin de mois, peuvent être inclus dans l'indice le mois suivant si les renseignements sur les titres et leur prix sont immédiatement disponibles. |
| Réinvestissement des flux de trésorerie | |
| Nouvelles émissions | |

Source : Solactive

Tarification et questions connexes

| | |
|--------------------------------------|--|
| Source et fréquence | <ul style="list-style-type: none"> L'indice est calculé et distribué une fois par jour ouvrable. |
| Moment | <ul style="list-style-type: none"> 16 h (HE) ou à la fermeture anticipée du marché, le cas échéant. Si le dernier jour ouvrable est un jour férié, on utilise les prix du jour ouvrable précédent. |
| Côté acheteur ou côté vendeur | <ul style="list-style-type: none"> Les obligations comprises dans l'indice sont cotées du côté acheteur. |



Tarification et questions connexes

| | |
|--------------------------------|---|
| Hypothèses de règlement | <ul style="list-style-type: none">• Les intérêts courus sont calculés à compter de la date de la convention de règlement (t+0). |
| Couverture de change | <ul style="list-style-type: none">• La méthodologie de couverture de change de l'indice prend en compte les contrats à terme d'un mois qui sont réinitialisés à la fin de chaque mois et couvre chaque obligation non libellée en devises de l'indice dans la monnaie de publication. Aucun ajustement n'est apporté à la couverture au cours du mois pour tenir compte des fluctuations de prix des titres constituant l'indice. |
| Calendrier | <ul style="list-style-type: none">• L'indice suit le calendrier des jours fériés aux États-Unis, conformément à la SIFMA. |

Source : Solactive

Les placements dans les fonds négociés en bourse peuvent donner lieu à des commissions, des frais de gestion et d'autres frais. Veuillez lire le prospectus avant d'investir. Les fonds négociés en bourse (FNB) ne sont pas garantis, leur valeur varie fréquemment, et leur rendement antérieur peut ne pas se reproduire. Le contenu de cette présentation (y compris les faits, les perspectives, les opinions, les recommandations, les descriptions de produits ou de titres, ou les références à des produits ou à des titres) ne doit pas être pris ni être interprété comme un conseil en matière de placement ni comme une offre de vendre ou une sollicitation d'offre d'achat, ou une promotion, recommandation ou commandite de toute entité ou de tout titre cité. Bien que nous nous efforcions d'en assurer l'exactitude et l'exhaustivité, nous n'assumons aucune responsabilité quant à son utilisation.

Le FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA), n'est pas parrainé, promu, vendu ni appuyé d'aucune autre manière par Solactive AG qui ne donne aucune garantie, expresse ou implicite, quant aux résultats pouvant découler de l'utilisation de l'indice, des marques de commerce et/ou quant au prix de l'indice à quelque moment que ce soit ou à tout autre égard. L'indice Solactive Select USD Investment Grade Corporate Hedged to CAD (RT) est calculé et publié par Solactive AG. Solactive AG fait de son mieux pour s'assurer que l'indice est correctement comptabilisé. Sans égard à ses obligations envers l'émetteur, Solactive AG n'a aucunement l'obligation de signaler les erreurs dans l'indice aux tiers, y compris aux investisseurs et aux intermédiaires financiers du FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA). La publication de l'indice par Solactive AG ou la concession de licence de l'indice, ou encore la marque de commerce de l'indice pour permettre de s'en servir relativement au FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA) ne constitue pas une recommandation de Solactive AG d'investir le capital dans ledit FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA) et ne représente pas non plus une garantie ni une opinion de Solactive AG en ce qui a trait aux placements effectués dans le FINB Obligations de sociétés américaines de qualité Mackenzie (couvert en \$ CA).