

FNB de revenu fixe à rendement élevé mondial Mackenzie

Revenu fixe à rendement élevé

Rendement annualisé composé 31/10/2022

| | |
|---------------------------------|---------|
| 1 mois | 1,2 % |
| 3 mois | -2,9 % |
| Année à ce jour | -12,3 % |
| 1 an | -11,8 % |
| 2 ans | -2,6 % |
| 3 ans | -0,0 % |
| 5 ans | 1,4 % |
| Depuis le lancement (avr. 2017) | 1,7 % |

Répartition régionale 30/09/2022

| | |
|-----------------------------|--------------|
| TRÉSORERIE ET ÉQUIV. | |
| Trésorerie et équivalents | 6,6 % |
| GLOBALEMENT | |
| États-Unis | 45,4 % |
| Canada | 27,9 % |
| Brésil | 3,9 % |
| Royaume-Uni | 3,3 % |
| Luxembourg | 2,7 % |
| Mexique | 2,5 % |
| Pays-Bas | 2,0 % |
| Colombie | 1,1 % |
| Chili | 1,0 % |
| Autres*** | 3,6 % |
| total | 100 % |

Répartition sectorielle 30/09/2022

| | |
|---|--------------|
| Obligations de sociétés | 87,3 % |
| Prêts bancaires | 5,5 % |
| Actions | 2,2 % |
| Titres à revenu fixe étrangers | 1,9 % |
| Titres adossés à des créances hypothécaires | 0,6 % |
| Trésorerie et équivalents | 6,6 % |
| Autres | -4,1 % |
| total | 100 % |

Répartition par cote** 30/09/2022

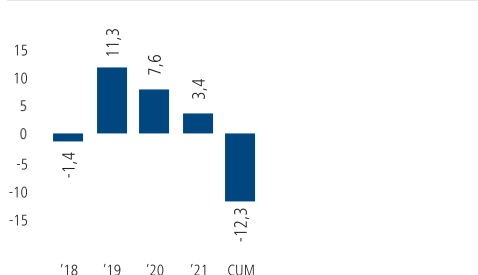
| | | | |
|-----|--------|---------------------------|--------|
| AAA | 0,5 % | CCC | 6,4 % |
| AA | 3,5 % | Oblig. non évaluées | 10,7 % |
| A | 0,5 % | Actions | 2,2 % |
| BBB | 9,5 % | Autres | -3,6 % |
| BB | 38,0 % | Trésorerie et équivalents | 6,6 % |
| B | 25,7 % | | |

Les portefeuillistes

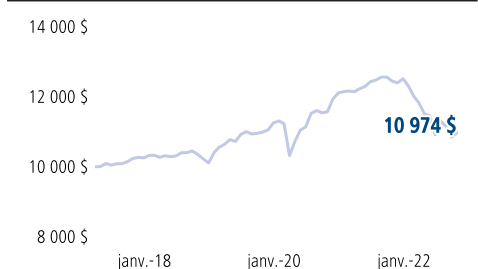
Équipe des placements à revenu fixe Mackenzie

Steve Locke, Dan Cooper, Konstantin Boehmer, Movin Mokbel, Felix Wong

Rendement pour l'année civile (%) 31/10/2022



Valeur d'un placement de 10 000 \$ 31/10/2022



Principaux titres 30/09/2022

Les principaux titres représentent 15,0 % du fonds

| | |
|--------------------------|-------|
| Cash, Cash Equivalents 1 | 6,6 % |
| ENBCN 5 3/8 09/27/77 | 1,2 % |
| KEYCN 6.875 06/13/2079 | 1,0 % |
| ATHENA 6 1/2 02/15/30 | 1,0 % |
| FAGEGA 5 5/8 08/15/26 | 1,0 % |
| VETCN 6 7/8 05/01/30 | 0,9 % |
| IPLCN 6.875 03/26/2079 | 0,8 % |
| TEVA 2.8 07/21/23 | 0,8 % |
| UBERUS 8 11/01/2026 | 0,8 % |
| RCICN 5 1/4 03/15/2082 | 0,8 % |

NOMBRE TOTAL DE TITRES : 522

Évaluation du risque du fonds

| | |
|------------------------------|------|
| Écart-type ann. | 8,0 |
| Écart-type ann. ind. de réf. | 9,4 |
| Alpha | 1,7 |
| Bêta | 0,8 |
| R-carré | 1,0 |
| Ratio de Sharpe | -0,1 |

Source : Placements Mackenzie

Données clés sur le fonds 30/09/2022

| | |
|---|---|
| Symbole : | MHYB |
| Actif total du fonds : | 232,91 millions \$ |
| Valeur liquidative par titre (31/10/2022) : | 16,76 \$ |
| CUSIP : | 55454M106 |
| Date d'inscription : | 26/04/2017 |
| Indice de référence* : | 75 % indice BofAML Global High Yield (couvert en \$CA) + 25 % indice BofAML Global Broad Market (couvert en \$CA) |
| Catégorie du fonds : | Revenu fixe à rendement élevé |
| Fréquence de distribution : | Mensuelle |
| Admissibilité RRD : | Oui |
| Frais de gestion : | 0,60 % |
| Duration modifiée : | 4,78 an(s) |
| Rendement à l'échéance : | 9,04 % |
| Coupon moyen pondéré : | 5,51 % |
| Rendement des distributions : | 4,66 % |

Terme jusqu'à l'échéance (ans) 30/09/2022

| | |
|---------------------------|--------------|
| 0 - 1 an | 1,9 % |
| 1 - 2 ans | 1,3 % |
| 2 - 3 ans | 4,8 % |
| 3 - 5 ans | 21,8 % |
| 5 - 7 ans | 24,7 % |
| 7 - 10 ans | 24,4 % |
| 10 - 15 ans | 1,1 % |
| 20+ ans | 14,9 % |
| Actions | 2,2 % |
| Autres | -3,7 % |
| Trésorerie et équivalents | 6,6 % |
| total | 100 % |

Pourquoi investir dans ce fonds?

- Rehausse le potentiel de rendement étant donné que l'équipe recherche continuellement dans le monde entier des titres à revenu fixe ayant un profil risque-rendement favorable.
- La gestion active à travers une étude minutieuse du crédit aide à découvrir les occasions les plus attrayantes au sein de la catégorie d'actif.
- Potential de diversification du portefeuille étant donné que les obligations à rendement élevé ont une plus faible corrélation avec les obligations traditionnelles.

Tolérance au risque

| | | |
|--------|---------|--------|
| FAIBLE | MOYENNE | ÉLEVÉE |
|--------|---------|--------|

* L'indice mixte est composé à 75 % de l'indice BofAML Global High Yield (couvert en \$CA) et à 25 % de l'indice BofAML Global Broad Market (couvert en \$CA).

** Les détails concernant la répartition par cote sont fournis par une ou plusieurs sources, dont DBRS, S&P, Bloomberg, FTSE TMX et Citigroup Corp.

*** Autres comprend les contrats de change.