

FONDS MONDIAL D'OBLIGATIONS DURABLES MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2021

Aperçu du portefeuille

<i>Répartition du portefeuille</i>	<i>% de la valeur liquidative</i>
Obligations	97,9
<i>Obligations</i>	95,5
<i>Positions acheteur sur contrats à terme*</i>	2,6
<i>Positions vendeur sur contrats à terme**</i>	(0,2)
Trésorerie et placements à court terme	5,3
Options sur devises vendues†	0,0
Swaps††	0,0
Autres éléments d'actif (de passif)	(3,2)

<i>Répartition régionale</i>	<i>% de la valeur liquidative</i>
États-Unis	54,1
Canada	23,2
Luxembourg	5,5
Trésorerie et placements à court terme	5,3
Philippines	3,8
Brésil	2,5
Chili	1,6
Pays-Bas	1,3
Norvège	1,0
Espagne	0,9
Autre	0,7
Australie	0,7
Suède	0,7
Mexique	0,7
Panama	0,6
Chine	0,6
Autres éléments d'actif (de passif)	(3,2)

<i>Répartition sectorielle</i>	<i>% de la valeur liquidative</i>
Obligations de sociétés	45,5
Obligations d'État étrangères	30,6
Obligations supranationales	13,9
Prêts à terme	6,5
Trésorerie et placements à court terme	5,3
Obligations fédérales	1,0
Obligations municipales	0,3
Obligations provinciales	0,3
Autre	(0,2)
Autres éléments d'actif (de passif)	(3,2)

<i>Exposition nette aux devises</i>	<i>% de la valeur liquidative</i>
Dollar canadien	86,3
Yuan chinois	3,8
Dollar américain	3,5
Peso mexicain	3,3
Rand sud-africain	1,6
Peso chilien	1,0
Real brésilien	0,8
Autre	(0,3)

* Les valeurs théoriques représentent 2,6 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations américaines à 5 ans.

** Les valeurs théoriques représentent -5,4 % de la valeur liquidative des contrats à très long terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans, -4,7 % de la valeur liquidative des contrats à très long terme sur obligations du Trésor américain de CME, -9,2 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations Euro-Bobl, -1,5 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations Euro-Buxl à 30 ans, -2,2 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur euro-obligations à long terme du gouvernement italien (BTP), -2,9 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations euro-OAT et -9,3 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans.

† Les valeurs théoriques représentent 3,5 % de la valeur liquidative des options sur devises vendues.

†† Les valeurs théoriques représentent 0,5 % de la valeur liquidative des swaps sur paniers d'actions.



MACKENZIE
Placements

FONDS MONDIAL D'OBLIGATIONS DURABLES MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 30 juin 2021

Les 25 principales positions acheteur

Émetteur	% de la valeur liquidative
Trésorerie et placements à court terme	7,9
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,63 % 15-04-2023	7,6
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-01-2031	4,5
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,25 % 15-07-2029	3,9
Banque internationale pour la reconstruction et le développement 4,25 % 22-01-2026	3,8
Banque européenne d'investissement 1,70 % 15-11-2024	3,8
Banque asiatique de développement 2,38 % 29-04-2023	3,8
Obligations du Trésor des États-Unis 0,50 % 31-10-2027	2,9
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,25 % 15-02-2050	2,6
Obligations du Trésor des États-Unis 1,13 % 28-02-2027	1,5
Banque de Montréal 1,76 % 10-03-2026	1,3
TELUS Corp. 2,85 % 13-11-2031	1,2
NRG Energy Inc. 2,45 % 02-12-2027	1,2
Algonquin Power & Utilities Corp. 4,60 % 29-01-2029, rachetables 2028	1,0
Ontario Power Generation Inc. 3,22 % 08-04-2030, rachetables 2030	1,0
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 2,06 % 17-06-2027	1,0
Banque Nationale du Canada 1,53 % 15-06-2026	0,9
Mar Bidco SARL, prêt à terme B de premier rang, taux variable 21-04-2028	0,9
Organon & Co., prêt à terme B de premier rang, taux variable 08-04-2028	0,9
Torrid LLC, prêt à terme B de premier rang, taux variable 21-05-2028	0,9
LTR Intermediate Holdings Inc., prêt à terme B de premier rang, taux variable 23-04-2028	0,9
BCE Inc. 2,20 % 29-05-2028	0,9
GFL Environmental Inc. 3,50 % 01-09-2028	0,9
Gouvernement du Canada 2,00 % 01-12-2051	0,9
Atlantica Sustainable Infrastructure PLC 4,13 % 15-06-2028	0,9
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	57,1

Les 25 principales positions vendeur

Émetteur	% de la valeur liquidative
Contrats à très long terme sur obligations du Trésor américain de CME**	(0,1)
Contrats à très long terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans**	(0,1)
Contrats à terme sur obligations Euro-Bobl**	0,0
Contrats à terme sur euro-obligations à long terme du gouvernement italien (BTP)**	0,0
Contrats à terme sur obligations Euro-Buxl à 30 ans**	0,0
Contrats à terme sur obligations euro-OAT**	0,0
Contrats à terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans**	0,0
Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	(0,2)
Valeur liquidative totale du Fonds	40,8 millions \$

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 30 juin 2021 en raison des opérations de portefeuille continues du Fonds. 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 Fonds, où elles sont disponibles dans les 90 jours.



MACKENZIE
Placements