

# FNB D'OBLIGATIONS DE PRÊTS COLLATÉRALISÉS AAA MACKENZIE

## Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2025

### Aperçu du portefeuille

| RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE             | % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE |
|---|----------------------------|
| Obligations                             | 107,0                      |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie | 9,3                        |
| Autres éléments d'actif (de passif)     | (16,3)                     |

| RÉPARTITION RÉGIONALE                   | % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE |
|---|----------------------------|
| Îles Caïmans                            | 88,2                       |
| Jersey                                  | 11,1                       |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie | 9,3                        |
| Bermudes                                | 5,1                        |
| États-Unis                              | 2,6                        |
| Autres éléments d'actif (de passif)     | (16,3)                     |

| RÉPARTITION SECTORIELLE                     | % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE |
|---|----------------------------|
| Titres adossés à des créances hypothécaires | 107,0                      |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie     | 9,3                        |
| Autres éléments d'actif (de passif)         | (16,3)                     |

| OBLIGATIONS PAR NOTE DE CRÉDIT* | % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE |
|---------------------------------|----------------------------|
| AAA                             | 43,1                       |
| Sans note                       | 63,9                       |

\* Les notes de crédit et les catégories de crédit sont basées sur les notes d'une agence de notation désignée.

### LES 25 PRINCIPALES POSITIONS % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

| Émetteur   | % DE LA VALEUR LIQUIDATIVE |
|--|----------------------------|
| Trésorerie et équivalents de trésorerie                    | 9,3                        |
| Octagon Investment Partners 29, taux variable 18-07-2037   | 4,3                        |
| OHA Loan Funding Ltd., taux variable 19-01-2037            | 4,1                        |
| Madison Park Funding Ltd., taux variable 20-01-2037        | 3,4                        |
| Benefit Street Partners CLO Ltd., taux variable 25-07-2038 | 3,4                        |
| HalseyPoint CLO Ltd., taux variable 20-07-2036             | 3,4                        |
| Oaktree CLO Ltd., taux variable 15-07-2038                 | 3,4                        |
| Neuberger Berman CLO Ltd., taux variable 14-10-2036        | 3,4                        |
| Pikes Peak CLO, taux variable 20-07-2038                   | 2,6                        |
| Invesco CLO Ltd., taux variable 15-07-2038                 | 2,6                        |
| AB BSL CLO, taux variable 20-07-2037                       | 2,6                        |
| ICG US CLO Ltd., taux variable 18-07-2038                  | 2,6                        |
| Anchorage Capital CLO Ltd., taux variable 20-07-2038       | 2,6                        |
| Ares CLO Ltd., taux variable 15-07-2038                    | 2,6                        |
| Elmwood CLO 23 Ltd., taux variable 16-04-2036              | 2,6                        |
| AIMCo, taux variable 22-07-2037                            | 2,5                        |
| CIFC Funding Ltd., taux variable 22-01-2038                | 1,7                        |
| Regatta Funding, taux variable 17-07-2037                  | 1,7                        |
| Elmwood CLO II Ltd., taux variable 20-10-2037              | 1,7                        |
| Magnetite CLO Ltd., taux variable 20-04-2037               | 1,7                        |
| New Mountain CLO Ltd., taux variable 15-01-2038            | 1,7                        |
| Carlyle Global Market Strategies, taux variable 15-10-2037 | 1,7                        |
| Octagon Credit Partners 46 Ltd., taux variable 15-07-2036  | 1,7                        |
| Generate CLO Ltd., taux variable 22-10-2037                | 1,7                        |
| Oak Hill Credit, taux variable 19-07-2037                  | 1,7                        |

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale **70,7**

Valeur liquidative totale du FNB **79,5 millions \$**

Le FNB ne détenait aucune position vendeur à la clôture de la période.

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 30 juin 2025 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.



**MACKENZIE**  
Placements