

FNB MONDIAL D'OBLIGATIONS DURABLES MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2022

Aperçu du portefeuille

RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	108,0
Obligations	98,0
Contrats à terme sur obligations (acheteur)*	9,7
Contrats à terme sur obligations (vendeur)*	0,3
Options achetées**	0,0
Autres éléments d'actif (de passif)	1,5
Options sur devises achetées†	0,0
Options sur devises vendues†	(0,0)
Trésorerie et placements à court terme	(9,5)

RÉPARTITION RÉGIONALE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
États-Unis	40,1
Canada	36,0
Autre	6,5
Pays-Bas	4,8
Allemagne	4,2
Chili	2,9
Luxembourg	2,7
Brésil	2,3
Pologne	2,2
Belgique	2,0
Autres éléments d'actif (de passif)	1,5
Japon	1,3
Mexique	1,1
Hong Kong	1,1
Norvège	0,8
Trésorerie et placements à court terme	(9,5)

RÉPARTITION SECTORIELLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations de sociétés	68,8
Obligations d'État étrangères	28,8
Obligations fédérales	4,8
Prêts à terme	2,9
Autres éléments d'actif (de passif)	1,5
Obligations municipales	1,2
Obligations provinciales	1,2
Autre	0,3
Trésorerie et placements à court terme	(9,5)

EXPOSITION NETTE AUX DEVISES	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Dollar canadien	104,6
Real brésilien	0,8
Dollar néo-zélandais	0,8
Rand sud-africain	0,7
Autre	0,5
Yen japonais	(1,0)
Euro	(1,1)
Couronne norvégienne	(1,4)
Dollar américain	(3,9)

* Les valeurs théoriques représentent 9,7 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations (acheteur) et -101,3 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations (vendeur).

** Les valeurs théoriques représentent 2,4 % de la valeur liquidative des options achetées.

† Les valeurs théoriques représentent 21,8 % de la valeur liquidative des options sur devises achetées et -17,7 % de la valeur liquidative des options sur devises vendues.



MACKENZIE
Placements

FNB MONDIAL D'OBLIGATIONS DURABLES MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 30 juin 2022

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS ACHETEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur	
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-01-2032	4,6
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-02-2052	3,6
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-04-2027	3,6
Enel Finance International NV 5,00 % 15-06-2032	3,0
Banque internationale pour la reconstruction et le développement 0 % 31-03-2027	2,9
Banque internationale pour la reconstruction et le développement 6,25 % 07-10-2026	2,3
Gouvernement de la Pologne 1,13 % 07-08-2026	2,2
Gouvernement de la Belgique 1,25 % 22-04-2033	2,0
Bruce Power L.P. 2,68 % 21-12-2028	1,7
Fiducie de placement immobilier industriel Dream 2,54 % 07-12-2026	1,6
iA Société financière inc., taux variable 25-02-2032	1,6
Obligations du Trésor des États-Unis 1,88 % 15-11-2051	1,5
Banque internationale pour la reconstruction et le développement 4,25 % 22-01-2026	1,4
La Banque de Nouvelle-Écosse 0,65 % 31-07-2024	1,4
Autodesk Inc. 2,40 % 15-12-2031	1,3
Banque Royale du Canada 1,15 % 14-07-2026	1,2
TerraForm Power Operating LLC 5,00 % 31-01-2028, rachetables 2027	1,2
Suzano Austria GmbH 2,50 % 15-09-2028	1,2
Gouvernement de l'Allemagne 0 % 15-08-2052	1,2
Ford Motor Co. 3,25 % 12-02-2032	1,2
Colbún SA 3,15 % 19-01-2032	1,2
Trésorerie et placements à court terme	1,2
République fédérale d'Allemagne, obligations indexées sur l'inflation, 0,10 % 15-04-2046	1,1
Seaspan Corp. 5,50 % 01-08-2029	1,1
Interchile SA 4,50 % 30-06-2056	1,1
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	46,4

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS VENDEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur	
Option de vente sur devises JPY/USD 06-07-2022, prix d'exercice 131,50 \$	(0,0)
Option de vente sur devises BRL/USD 05-08-2022, prix d'exercice 4,60 \$	(0,0)
Contrats à terme sur obligations américaines à 5 ans	0,0
Contrats à terme sur obligations Euro-Schatz	0,0
Contrats à terme sur euro-obligations à long terme du gouvernement italien (BTP)	0,1
Contrats à terme sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans	0,1
Contrats à terme sur obligations Euro-Bobl	0,1
Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	0,3
Valeur liquidative totale du FNB	178,3 millions \$

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 30 juin 2022 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