

FNB DE REVENU FIXE CANADIEN DE BASE PLUS MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2022

Aperçu du portefeuille

RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	94,2
Obligations	94,3
Options achetées*	0,1
Options vendues*	(0,0)
Contrats à terme sur obligations (vendeur)**	(0,2)
Trésorerie et placements à court terme	3,5
Autres éléments d'actif (de passif)	2,2
Actions	0,1

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Canada	72,3
États-Unis	16,0
Trésorerie et placements à court terme	3,5
Autres éléments d'actif (de passif)	2,2
Autre	1,9
Royaume-Uni	1,1
Chine	0,5
Mexique	0,5
Australie	0,4
Chili	0,3
Pays-Bas	0,3
Luxembourg	0,3
Japon	0,3
Brésil	0,2
Indonésie	0,2

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations de sociétés	46,0
Obligations fédérales	20,0
Obligations provinciales	17,1
Obligations d'État étrangères	5,7
Prêts à terme	4,8
Trésorerie et placements à court terme	3,5
Autres éléments d'actif (de passif)	2,2
Titres adossés à des créances hypothécaires	0,6
Obligations municipales	0,1
Services publics	0,1
Autre	(0,1)

EXPOSITION NETTE EFFECTIVE AUX DEVISES	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Dollar canadien	98,1
Dollar américain	1,9

* Les valeurs théoriques représentent 3,5 % de la valeur liquidative des options achetées et -3,3 % de la valeur liquidative des options vendues.

** Les valeurs théoriques représentent -33,5 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations (vendeur).

La répartition effective présente l'exposition du FNB par portefeuille, région ou secteur ou l'exposition nette aux devises calculée en combinant les placements directs et indirects du FNB.



MACKENZIE
Placements

FNB DE REVENU FIXE CANADIEN DE BASE PLUS MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 30 juin 2022

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS ACHETEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur/Fonds sous-jacent	
Gouvernement du Canada 1,50 % 01-12-2031	12,0
Trésorerie et placements à court terme	3,9
Gouvernement du Canada 1,50 % 01-06-2031	3,7
Province de Québec 3,10 % 01-12-2051	3,1
FNB de revenu à taux variable Mackenzie	2,7
Province de l'Alberta 3,10 % 01-06-2050	2,2
FINB Obligations de marchés émergents en monnaie locale Mackenzie	2,1
Fiducie du Canada pour l'habitation 1,10 % 15-03-2031	2,1
Obligations du Trésor des États-Unis 2,38 % 15-02-2042	1,8
Province de l'Ontario 2,55 % 02-12-2052	1,5
Province de la Colombie-Britannique 1,55 % 18-06-2031	1,4
Province de Québec 1,50 % 01-09-2031	1,4
Province de l'Ontario 1,90 % 02-12-2051	1,1
Obligations du Trésor des États-Unis 2,25 % 15-02-2052	0,9
FINB Obligations canadiennes totales Mackenzie	0,8
Province de la Saskatchewan 2,80 % 02-12-2052	0,8
Province de la Colombie-Britannique 2,95 % 18-06-2050	0,8
FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	0,8
Province de l'Ontario 1,55 % 01-11-2029	0,6
Province de l'Alberta 2,95 % 01-06-2052	0,6
Province de Québec 3,25 % 01-09-2032	0,6
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-02-2052	0,6
Morgan Stanley 3,00 % 07-02-2024	0,6
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	0,5
FINB Obligations de marchés émergents Mackenzie (couvert en \$ CA)	0,5
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	47,1

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS VENDEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur	
Contrats à terme sur obligations Euro-Bobl	(0,2)
iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF option de vente souscrite @ 70,00 \$ éch. 15-07-2022	(0,0)
Invesco Senior Loan ETF, option de vente souscrite @ 19,00 \$ éch. 15-07-2022	(0,0)
Contrats à terme sur obligations Euro-Schatz	0,0
Contrats à terme sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans	0,0
Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	(0,2)
Valeur liquidative totale du FNB	494,7 millions \$

Pour le prospectus et d'autres renseignements concernant le ou les fonds sous-jacents du portefeuille, veuillez consulter les adresses suivantes : www.placementsmackenzie.com ou www.sedar.com.

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