

FNB MONDIAL D'OBLIGATIONS DURABLES MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2022

Aperçu du portefeuille

RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	99,4
Obligations	91,9
Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)*	6,3
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)*	1,2
Autres éléments d'actif (de passif)	7,6
Options sur devises achetées**	–
Trésorerie et placements à court terme	(7,0)

RÉPARTITION RÉGIONALE

RÉPARTITION RÉGIONALE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Canada	33,7
États-Unis	29,2
Autre	8,5
Autres éléments d'actif (de passif)	7,6
Pays-Bas	3,8
Allemagne	3,7
Luxembourg	3,4
Chili	3,2
Brésil	2,5
Pologne	2,3
Royaume-Uni	2,3
Nouvelle-Zélande	2,0
Belgique	1,9
Chine	1,5
Japon	1,4
Trésorerie et placements à court terme	(7,0)

RÉPARTITION SECTORIELLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations de sociétés	69,4
Obligations d'État étrangères	20,5
Autres éléments d'actif (de passif)	7,6
Obligations fédérales	4,1
Obligations provinciales	2,0
Obligations municipales	1,2
Autre	1,2
Prêts à terme	1,0
Trésorerie et placements à court terme	(7,0)

* Les valeurs théoriques représentent 6,3 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur) et –60,1 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur).

** Les valeurs théoriques représentent 3,4 % de la valeur liquidative des options sur devises achetées.



MACKENZIE
Placements

FNB MONDIAL D'OBLIGATIONS DURABLES MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 31 décembre 2022

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS ACHETEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur	
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,13 % 15-02-2052	3,1
Banque internationale pour la reconstruction et le développement 0 % 31-03-2027	2,8
Banque internationale pour la reconstruction et le développement 6,25 % 07-10-2026	2,4
Gouvernement de la Pologne 1,13 % 07-08-2026	2,3
Gouvernement de la Nouvelle-Zélande 4,25 % 15-05-2034	2,0
Gouvernement de la Belgique 1,25 % 22-04-2033	1,9
Gouvernement du Canada 0,50 % 01-12-2030	1,8
Athabasca Indigenous Midstream LP 6,07 % 05-02-2042	1,7
Bruce Power L.P. 2,68 % 21-12-2028	1,7
iA Société financière inc., taux variable 25-02-2032	1,6
Enel Finance International NV 5,00 % 15-06-2032	1,5
Banque internationale pour la reconstruction et le développement 4,25 % 22-01-2026	1,5
Lenovo Group Ltd. 6,54 % 27-07-2032	1,5
Autodesk Inc. 2,40 % 15-12-2031	1,4
Obligations du Trésor des États-Unis 1,88 % 15-11-2051	1,3
Colbún SA 3,15 % 19-01-2032	1,3
Suzano Austria GmbH 2,50 % 15-09-2028	1,3
Ford Motor Co. 3,25 % 12-02-2032	1,2
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 27-07-2082	1,2
Banque Nationale du Canada 5,30 % 03-11-2025	1,2
TerraForm Power Operating LLC 5,00 % 31-01-2028, rachetables 2027	1,2
Régime de retraite des enseignantes et des enseignants de l'Ontario 4,45 % 02-06-2032	1,2
PepsiCo Inc. 3,90 % 18-07-2032	1,1
Interchile SA 4,50 % 30-06-2056	1,1
Arcos Dorados BV 6,13 % 27-05-2029	1,1
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	40,4

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS VENDEUR	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur	
Contrats à très long terme sur obligations du Trésor américain de CME	–
Contrats à terme standardisés sur obligations américaines à 5 ans	–
Contrats à terme standardisés sur obligations Euro-Schatz	–
Contrats à terme standardisés sur obligations Euro-Bobl	0,3
Contrats à terme standardisés sur euro-obligations à long terme du gouvernement italien (BTP)	0,4
Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans	0,5
Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	1,2
Valeur liquidative totale du FNB	180,4 millions \$

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 31 décembre 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