

FNB DE REVENU FIXE CANADIEN DE BASE PLUS MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2021

Aperçu du portefeuille

Répartition effective du portefeuille % de la valeur liquidative

| | |
|---|------|
| Obligations | 98,0 |
| Obligations | 98,0 |
| Positions vendeur sur contrats à terme* | 0,0 |
| Trésorerie et placements à court terme | 1,3 |
| Autres éléments d'actif (de passif) | 0,4 |
| Actions | 0,3 |

Répartition régionale effective % de la valeur liquidative

| | |
|--|------|
| Canada | 68,9 |
| États-Unis | 18,6 |
| Chine | 4,3 |
| Autre | 2,2 |
| Trésorerie et placements à court terme | 1,3 |
| Royaume-Uni | 1,1 |
| Luxembourg | 0,7 |
| Australie | 0,4 |
| Mexique | 0,4 |
| Autres éléments d'actif (de passif) | 0,4 |
| Chili | 0,3 |
| Pays-Bas | 0,3 |
| Japon | 0,3 |
| Brésil | 0,2 |
| Irlande | 0,2 |
| Indonésie | 0,2 |
| Panama | 0,2 |

Répartition sectorielle effective % de la valeur liquidative

| | |
|---|------|
| Obligations de sociétés | 44,2 |
| Obligations provinciales | 22,1 |
| Obligations fédérales | 13,2 |
| Prêts à terme | 10,6 |
| Obligations d'État étrangères | 7,1 |
| Trésorerie et placements à court terme | 1,3 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires | 0,7 |
| Autres éléments d'actif (de passif) | 0,4 |
| Services publics | 0,2 |
| Énergie | 0,1 |
| Obligations municipales | 0,1 |

Exposition nette effective aux devises % de la valeur liquidative

| | |
|------------------|------|
| Dollar canadien | 94,3 |
| Yuan chinois | 3,6 |
| Dollar américain | 1,5 |
| Autre | 0,6 |

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.

Les 25 principales positions acheteur

| Émetteur/Fonds sous-jacent | % de la valeur liquidative |
|---|----------------------------|
| Province de Québec 3,10 % 01-12-2051 | 4,0 |
| Gouvernement du Canada 1,50 % 01-06-2031 | 4,0 |
| Province de l'Ontario 2,25 % 02-12-2031 | 3,7 |
| FNB de revenu à taux variable Mackenzie | 3,6 |
| Fiducie du Canada pour l'habitation 1,10 % 15-03-2031 | 2,5 |
| FINB Obligations de marchés émergents en monnaie locale Mackenzie | 2,2 |
| Province de Québec 1,50 % 01-09-2031 | 2,1 |
| Fiducie du Canada pour l'habitation, taux variable 15-03-2026 | 1,9 |
| Gouvernement de la Chine 3,27 % 19-11-2030 | 1,7 |
| Gouvernement de la Chine 1,99 % 09-04-2025 | 1,7 |
| Province de la Colombie-Britannique 1,55 % 18-06-2031 | 1,5 |
| Province de l'Ontario 1,90 % 02-12-2051 | 1,4 |
| Province de l'Alberta 3,10 % 01-06-2050 | 1,2 |
| Gouvernement du Canada 2,00 % 01-12-2051 | 1,2 |
| Fiducie du Canada pour l'habitation 1,75 % 15-06-2030 | 1,2 |
| Trésorerie et placements à court terme | 1,0 |
| Province de la Colombie-Britannique 2,95 % 18-06-2050 | 1,0 |
| Province de la Saskatchewan 2,80 % 02-12-2052 | 0,9 |
| FNB mondial d'obligations durables Mackenzie | 0,8 |
| Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,25 % 15-02-2050 | 0,7 |
| Province de l'Ontario 1,55 % 01-11-2029 | 0,7 |
| Gouvernement du Canada 1,75 % 01-12-2053 | 0,7 |
| Province de l'Ontario 3,45 % 02-06-2045 | 0,6 |
| Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,75 % 15-07-2028 | 0,6 |
| OMERS Finance Trust 1,55 % 21-04-2027 | 0,6 |

Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale 41,5

* Les valeurs théoriques représentent -2,8 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans, -1,2 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations américaines à 5 ans, -1,3 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations euro-OAT et -6,9 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations Euro-Bobl.



MACKENZIE
Placements

FNB DE REVENU FIXE CANADIEN DE BASE PLUS MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 31 décembre 2021

Les 25 principales positions vendeur

| Émetteur | % de la valeur liquidative |
|--|-----------------------------------|
| Contrats à terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans* | (0,0) |
| Contrats à terme sur obligations américaines à 5 ans* | (0,0) |
| Contrats à terme sur obligations euro-OAT* | 0,0 |
| Contrats à terme sur obligations Euro-Bobl* | 0,0 |

| | |
|--|------------|
| Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale | 0,0 |
|--|------------|

Valeur liquidative totale du FNB **541,2 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 31 décembre 2021 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.

