

FONDS À RENDEMENT ABSOLU DE TITRES DE CRÉANCE MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 30 juin 2023

Aperçu du portefeuille

RÉPARTITION DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Obligations	86,7	(2,6)	84,1
Obligations	77,9	(2,6)	75,3
Contrats à terme standardisés*	8,7	–	8,7
Options achetées**	0,1	–	0,1
Options vendues**	–	–	–
Trésorerie et équivalents de trésorerie	9,0	–	9,0
Autres éléments d'actif (de passif)	3,8	–	3,8
Fonds privés	2,8	–	2,8
Actions	0,5	–	0,5
Swaps†	0,1	–	0,1
Options sur swaps achetées††	–	–	–
Fonds/billets négociés en bourse	0,5	(0,8)	(0,3)

RÉPARTITION RÉGIONALE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
États-Unis	41,2	(2,7)	38,5
Canada	32,6	(0,7)	31,9
Trésorerie et équivalents de trésorerie	9,0	–	9,0
Australie	4,9	–	4,9
Autres éléments d'actif (de passif)	3,8	–	3,8
Luxembourg	1,9	–	1,9
Royaume-Uni	1,7	–	1,7
Suisse	1,5	–	1,5
Chine	1,3	–	1,3
Pays-Bas	1,0	–	1,0
France	0,9	–	0,9
Autre	0,8	–	0,8
Brésil	0,7	–	0,7
Espagne	0,6	–	0,6
Inde	0,3	–	0,3
Italie	0,3	–	0,3
Mexique	0,3	–	0,3
Colombie	0,3	–	0,3
Israël	0,3	–	0,3

RÉPARTITION SECTORIELLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE		
	Positions acheteur	Positions vendeur	Montant net
Obligations de sociétés	71,2	(2,6)	68,6
Obligations d'État étrangères	14,6	–	14,6
Trésorerie et équivalents de trésorerie	9,0	–	9,0
Autres éléments d'actif (de passif)	3,8	–	3,8
Fonds privés	2,8	–	2,8
Titres adossés à des créances hypothécaires	0,9	–	0,9
Services financiers	0,5	–	0,5
Autre	0,1	–	0,1
Fonds/billets négociés en bourse	0,5	(0,8)	(0,3)

* Les valeurs théoriques représentent 8,8 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur) et –11,0 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur).

** Les valeurs théoriques représentent 26,0 % de la valeur liquidative des options achetées et –23,5 % de la valeur liquidative des options vendues.

† Les valeurs théoriques représentent 30,3 % de la valeur liquidative des swaps.

†† Les valeurs théoriques représentent 301,9 % de la valeur liquidative des options sur swaps achetées.



MACKENZIE
Placements

FONDS À RENDEMENT ABSOLU DE TITRES DE CRÉANCE MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 30 juin 2023

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS ACHETEUR

Émetteur	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Trésorerie et équivalents de trésorerie	17,8
Obligations du Trésor des États-Unis 1,88 % 28-02-2027	4,8
La Banque de Nouvelle-Écosse, taux variable 15-09-2023	2,7
Northleaf Private Credit II LP ¹⁾	1,9
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	1,9
La Banque Toronto-Dominion, taux variable 31-01-2025	1,6
Weatherford International Ltd. 8,63 % 30-04-2030	1,3
Gray Television Inc. 5,38 % 15-11-2031	1,2
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,50 % 15-04-2024	1,1
Vermilion Energy Inc. 6,88 % 01-05-2030	1,0
Inter Pipeline Ltd., taux variable 19-11-2079, rachetables 2029	1,0
Secure Energy Services Inc. 7,25 % 30-12-2026	1,0
VistaJet Malta Finance PLC 6,38 % 01-02-2030	1,0
Pembina Pipeline Corp., taux variable 25-01-2081	0,9
Sagard Credit Partners II LP ¹⁾	0,9
Compagnie Crédit Ford du Canada 2,96 % 16-09-2026	0,9
Keyera Corp., taux variable 13-06-2079, rachetables 2029	0,8
New Red Finance Inc. 4,00 % 15-10-2030	0,8
Algonquin Power & Utilities Corp., taux variable 18-01-2082	0,8
Vidéotron Itée 4,50 % 15-01-2030, rachetables 2024	0,8
Corporation Parkland du Canada 4,50 % 01-10-2029	0,8
Vidéotron Itée 3,13 % 15-01-2031	0,7
Capital Power Corp., taux variable 09-09-2082	0,7
Domtar Corp. 6,75 % 01-10-2028	0,7
Tamarack Valley Energy Ltd. 7,25 % 10-05-2027	0,7
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	47,8

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS VENDEUR

Émetteur/Fonds sous-jacent	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
SPDR Bloomberg Barclays Convertible Securities ETF	(0,8)
Bombardier Inc. 7,88 % 15-04-2027, rachetables 2022	(0,4)
Bombardier Inc. 6,00 % 15-02-2028	(0,3)
TRI Pointe Group Inc. 5,70 % 15-06-2028	(0,3)
Griffon Corp. 5,75 % 01-03-2028, rachetables 2023	(0,3)
Credit Acceptance Corp. 6,63 % 15-03-2026, rachetables 2022	(0,2)
United States Steel Corp. 6,88 % 01-03-2029	(0,2)
Eco Material Technologies Inc. 7,88 % 31-01-2027	(0,2)
Bread Financial Holdings Inc. 7,00 % 15-01-2026	(0,2)
Coty Inc. 4,75 % 15-01-2029	(0,2)
W. R. Grace Holdings LLC 5,63 % 15-08-2029	(0,2)
Paramount Global 4,20 % 19-05-2032	(0,1)
Murphy Oil Corp. 5,88 % 01-12-2027	(0,1)
Swap sur rendement total sur HYG éch. 11-07-2023	–
iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF	–
Swap sur rendement total sur HYG éch. 13-07-2023	–
iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF option de vente souscrite @ 66,00 \$ éch. 15-09-2023	–
Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans	–
Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans de moindre valeur	–
Contrats à terme standardisés sur euro-obligations	–
Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	(3,5)
Valeur liquidative totale du Fonds	102,1 millions \$

1) L'émetteur de ce titre est lié au gestionnaire.

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.sedarplus.com.

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 30 juin 2023 en raison des opérations de portefeuille continues du Fonds. 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 Fonds, où elles sont disponibles dans les 90 jours.



MACKENZIE
Placements