

FONDS DE REVENU MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2023

Aperçu du portefeuille

RÉPARTITION EFFECTIVE DU PORTEFEUILLE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations	73,1
Obligations	65,4
Contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur)*	7,8
Contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur)*	(0,1)
Actions	27,7
Autres éléments d'actif (de passif)	1,0
Fonds privés	0,5
Fonds communs de placement	0,1
Options sur swaps achetées**	–
Options sur swaps vendues**	–
Trésorerie et équivalents de trésorerie	(2,4)

RÉPARTITION RÉGIONALE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Canada	71,0
États-Unis	21,7
Autre	1,7
Royaume-Uni	1,2
Allemagne	1,1
Autres éléments d'actif (de passif)	1,0
France	0,7
Japon	0,7
Irlande	0,6
Pays-Bas	0,6
Suisse	0,5
Australie	0,5
Brésil	0,4
Mexique	0,3
Danemark	0,2
Chine	0,2
Trésorerie et équivalents de trésorerie	(2,4)

* Les valeurs théoriques représentent 7,5 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (acheteur) et –7,1 % de la valeur liquidative des contrats à terme standardisés sur obligations (vendeur).

** Les valeurs théoriques représentent 5,8 % de la valeur liquidative des options sur swaps achetées et –1,0 % de la valeur liquidative des options sur swaps vendues.

† Les notes de crédit et les catégories de crédit sont basées sur les notes d'une agence de notation désignée. Ce tableau présente uniquement les obligations détenues directement par le Fonds.

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

RÉPARTITION SECTORIELLE EFFECTIVE	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Obligations de sociétés	39,1
Obligations provinciales	17,9
Obligations fédérales	8,8
Services financiers	7,3
Obligations d'État étrangères	6,3
Énergie	3,4
Technologie de l'information	3,3
Produits industriels	3,2
Matériaux	2,4
Consommation de base	2,2
Soins de santé	2,0
Consommation discrétionnaire	1,7
Autre	1,3
Services de communication	1,2
Autres éléments d'actif (de passif)	1,0
Services publics	0,8
Fonds privés	0,5
Trésorerie et équivalents de trésorerie	(2,4)

OBLIGATIONS PAR NOTE DE CRÉDIT†	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
AAA	3,3
AA	13,6
A	16,8
BBB	15,2
Inférieure à BBB	3,7
Sans note	6,7



MACKENZIE
Placements

FONDS DE REVENU MACKENZIE

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 31 décembre 2023

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS ACHETEUR

	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur/Fonds sous-jacent	
Province de l'Ontario 3,65 % 02-06-2033	4,1
Province de Québec 3,60 % 01-09-2033	2,8
Province de Québec 4,40 % 01-12-2055	2,7
Obligations du Trésor des États-Unis 5,39 % 08-08-2024	2,3
FINB Obligations canadiennes totales Mackenzie	2,1
Fonds d'obligations de sociétés nord-américaines Mackenzie, série R	2,0
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 0,50 % 15-04-2024	1,3
Gouvernement du Canada 5,07 % 29-02-2024	1,2
Province de l'Ontario 4,15 % 02-12-2054	1,1
Fonds à rendement absolu de titres de créance Mackenzie, série R	1,1
Banque Royale du Canada	1,1
Province de l'Alberta 3,10 % 01-06-2050	1,1
Province de l'Alberta 2,95 % 01-06-2052	1,0
Fiducie du Canada pour l'habitation 2,90 % 15-06-2024	0,9
Banque de Montréal	0,9
La Banque Toronto-Dominion	0,7
Rogers Communications Inc., taux variable 17-12-2081	0,7
Obligations du Trésor des États-Unis indexées sur l'inflation 1,50 % 15-02-2053	0,7
Microsoft Corp.	0,7
Canadian Natural Resources Ltd.	0,7
Gouvernement du Canada 0,50 % 01-12-2050	0,6
Canadian Pacific Kansas City Ltd.	0,6
FNB mondial d'obligations durables Mackenzie	0,6
FINB Obligations à long terme du gouvernement canadien Mackenzie	0,6
Enbridge Inc. 5,37 % 27-09-2077, rachetables 2027	0,5
Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	32,1

LES 25 PRINCIPALES POSITIONS VENDEUR

	% DE LA VALEUR LIQUIDATIVE
Émetteur	
Contrats à terme standardisés sur obligations du gouvernement du Japon à 10 ans	(0,1)
Indice Markit North American Investment Grade CDX option de vente souscrite @ 93,00 \$ éch. 17-01-2024	–
Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale	(0,1)
Valeur liquidative totale du Fonds	1,3 milliard \$

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.ca.

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 31 décembre 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